

Legal & General UCITS ETF Plc

Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss für das
Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Legal & General Investment Management Limited
One Coleman Street
London EC2R 5AA



WICHTIGE INFORMATIONEN FÜR SCHWEIZER ANLEGER

Einige Teilfonds der Gesellschaft sind nicht zum Vertrieb in der Schweiz zugelassen. Folglich enthält dieser Bericht keine Informationen zu den betreffenden Teilfonds. Die Anleger werden jedoch darauf hingewiesen, dass bestimmte Informationen in diesem Bericht auf konsolidierter Basis angegeben sind und infolgedessen auch Informationen über diejenigen Teilfonds einschließen, die nicht für den Vertrieb in der Schweiz zugelassen sind.

Inhalt

Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss der Legal & General UCITS ETF Plc

Inhaltsverzeichnis	1
Verwaltungsrat und sonstige Informationen	2
Informationen über die Gesellschaft	4
Fondsbericht	10
Bericht des Verwaltungsrats	18
Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber vom 30. Juni 2023	40
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	41

Jahresabschluss der Gesellschaft

Bilanz der Gesamtgesellschaft	50
Gesamtergebnisrechnung der Gesamtgesellschaft	51
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens der Gesamtgesellschaft	52
Kapitalflussrechnung der Gesamtgesellschaft	53

Jahresabschlüsse der Fonds

Bilanz	
zum 30. Juni 2023	54
Vergleichsdaten zum 30. Juni 2022	60
Gesamtergebnisrechnung	
für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	65
Vergleichsdaten für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	72
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	
für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	78
Vergleichsdaten für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	82
Anmerkungen zum Halbjahresabschluss	86

Sonstige Informationen – ungeprüft

Aufstellung der Vermögenswerte	220
OGAW-V-Vergütungspolitik	569
Value-at-Risk-Bericht („VaR“-Bericht)	570
Weitere Informationen	571
Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	573
Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe	580
Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor	654
Wertentwicklung im Kalenderjahr (ungeprüft)	655

Der Prospekt, die PRIIP-Basisinformationsblätter (PRIIP-KID), die Satzung der Gesellschaft, der neueste Jahres- und Halbjahresbericht sowie die Käufe/Verkäufe sind kostenfrei beim Schweizer Vertreter zu beziehen, der State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich, Schweiz. Die Zahlstelle der Gesellschaft in der Schweiz ist die State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich, Schweiz.

Verwaltungsrat und sonstige Informationen

Verwaltungsrat:

Feargal Dempsey (Ire) ⁽¹⁾ ⁽²⁾
David Fagan (Ire) ⁽¹⁾
Howie Li (Brite)
Patrizia Libotte (Irin)
Donard McClean (Ire) ⁽¹⁾

Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführend

⁽¹⁾ Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

⁽²⁾ Vorsitzender

Verwaltungsgesellschaft:

LGIM Managers (Europe) Limited
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
D02 R296
Irland

Anlageverwalter:

Legal & General Investment Management Limited
One Coleman Street
London, EC2R 5AA
Vereinigtes Königreich

Unteranlageverwalter:

E Fund Management (Hong Kong) Co., Limited
Suites 3501-02, 35/F
Two International Finance Centre
8 Finance Street
Central
Hongkong

Verwahrstelle:

The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Riverside II, Sir John Rogerson's Quay
Grand Canal Dock
Dublin 2
D02 KV60
Irland

Listing Sponsor im Vereinigten Königreich:

J&E Davy
Davy House
49 Dawson Street
Dublin 2
D02 PY05
Irland

Eingetragener Sitz:

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

Verwalter, Transfer- und Registerstelle

BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company
One Dockland Central
Guild Street
International Financial Services Centre
Dublin 1
D01 E4X0
Irland

Gesellschaftssekretär:

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

Unabhängige Abschlussprüfer:

Ernst & Young
Chartered Accountants & Registered Auditors
Harcourt Centre
Harcourt Street
Dublin 2
D02 YA40
Irland

Verwaltungsrat und sonstige Informationen (Fortsetzung)

Rechtsberater in Irland:

William Fry
2 Grand Canal Square
Dublin 2
D02 A342
Irland

Globale Vertriebsstelle:

Legal & General Investment Management
Limited
One Coleman Street
London, EC2R 5AA
Vereinigtes Königreich

Vertriebsstellen:

Barclays Bank Plc
1 Churchill Place
London E14 5HP
Vereinigtes Königreich

Foxberry Ltd
Ebene 39
One Canada Square
Canary Wharf
London E14 5AB
Vereinigtes Königreich

Allfunds Bank, S.A.U.
Padres Dominicos, 7,
28050,
Madrid
Spanien

S Broker AG & Co. KG
Carl Bosch Str.10
65203 Wiesbaden
Deutschland

Registernummer: 459936

Vertriebsstellen:

1822direkt Gesellschaft der Frankfurter
Sparkasse mbH
Borsigallee 19
60388 Frankfurt am Main
Deutschland

Nordnet Bank AB
Box 30099
10425 Stockholm
Schweden

Directa S.I.M.P.A.
Via B. Buozi
5 - 10121 Torino
Italien

GERD KOMMER INVEST GMBH
Sendlinger str. 41,
80331 München
Deutschland

Sicherheitenverwalter:

The Bank of New York Mellon
One Canada Square
Canary Wharf
London, E14 5AL
Vereinigtes Königreich

Lokale Zahlstelle und Vertretung in der Schweiz:

State Street Bank International GmbH
Munich, Zurich Branch
Beethovenstrasse 19
CH-8027 Zürich

Dieser Jahresbericht und geprüfte Jahresabschluss (der „Bericht und Abschluss“) kann in andere Sprachen übersetzt werden. Eine solche Übersetzung darf nur dieselben Informationen und dieselbe Bedeutung enthalten wie der englischsprachige Bericht und Abschluss. Sofern der englischsprachige Bericht und Abschluss und der Bericht und Abschluss in einer anderen Sprache an irgendeiner Stelle differieren, ist der englischsprachige Bericht und Abschluss maßgeblich. Ausnahmsweise ist eine andere Sprache des Berichts und Abschlusses dann und insoweit maßgeblich, wie das Gesetz eines Hoheitsgebietes, in dem die Anteile vertrieben werden, dies für Klagen, die sich auf Veröffentlichungen in einem Bericht und Abschluss in einer anderen Sprache als Englisch beziehen, verlangt. Streitigkeiten über die Bestimmungen der Berichte und Abschlüsse unterliegen ungeachtet der Sprache des Berichts und Abschlusses irischem Recht und sind entsprechend auszulegen.

Informationen über die Gesellschaft

Legal & General UCITS ETF Plc (die „Gesellschaft“) ist als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital organisiert. Die Gesellschaft sieht getrennte Haftung zwischen ihren Teilfonds vor und ist organisiert als Gesellschaft mit beschränkter Haftung nach irischem Recht gemäß dem Companies Act 2014 (der „Companies Act“). Die Gesellschaft ist verpflichtet, sich an die Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 in ihrer jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) und die Vorschriften des Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Abschnitt 48(1)) betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren von 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) zu halten.

Das Ziel der Gesellschaft besteht in der gemeinsamen Anlage von auf dem Kapitalmarkt aufgebrauchten Geldern in Wertpapieren und anderen liquiden finanziellen Vermögenswerten nach dem Grundsatz der Risikostreuung gemäß den OGAW-Vorschriften.

Die Gesellschaft ist als Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds strukturiert und setzt sich aus separaten Teilfonds zusammen (jeweils ein „Fonds“, zusammen die „Fonds“), in denen der Verwaltungsrat jeweils mit vorheriger Genehmigung der Central Bank of Ireland (irische Zentralbank, die „Zentralbank“) verschiedene Anteilserien ausgeben kann, die separate Portfolios von Vermögenswerten repräsentieren. Das Vermögen der einzelnen Fonds wird gemäß dem Anlageziel und der Anlagestrategie investiert, die für den jeweiligen Fonds gelten und im Verkaufsprospekt der Gesellschaft (der „Verkaufsprospekt“) und im jeweiligen fondsspezifischen Prospektnachtrag (der „Nachtrag“) angegeben sind.

Zum 30. Juni 2023 waren die folgenden 62 Fonds (30. Juni 2022: 55 Fonds) der Gesellschaft von der Zentralbank genehmigt, von denen 49 (30. Juni 2022: 43 Fonds) am Ende des Geschäftsjahres für Zeichnungen zur Verfügung standen und ihre Geschäftstätigkeit ausübten. Die von den einzelnen Fonds jeweils nachgebildeten/replizierten Indizes sind ebenfalls nachstehend aufgeführt:

Name des Fonds	Fondsart	Indexname	Anlageverwalter / Unteranlageverwalter
L&G Gold Mining UCITS ETF	"	STOXX Global Gold Miners NR USD	Legal & General Investment Management Limited
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	"	ROBO Global Robotics and Automation UCITS Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Cyber Security UCITS ETF	"	ISE Cyber Security® UCITS Index Net Total Return	Legal & General Investment Management Limited
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	"	Solactive Battery Value-Chain Index Net Total Return	Legal & General Investment Management Limited
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	"	Solactive Pharma Breakthrough Value Index Net Total Return	Legal & General Investment Management Limited
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	"	Solactive eCommerce Logistics Index Net Total Return	Legal & General Investment Management Limited

¹ Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 15. Oktober 2019 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an dem Fonds ausgegeben.

Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

Name des Fonds	Fondsart	Indexname	Anlageverwalter / Unteranlageverwalter
L&G Clean Water UCITS ETF	"	Solactive Clean Water Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	"	ROBO Global® Artificial Intelligence Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	"	ROBO Global® Healthcare Technology and Innovation Index TR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³	"	Foxberry Sustainability Consensus Europe TR Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³	"	Foxberry Sustainability Consensus US TR Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Clean Energy UCITS ETF	"	Solactive Clean Energy Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	"	J.P. Morgan Global Credit Index (GCI) ESG Investment Grade GBP Short-Term Custom Maturity Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	"	J.P. Morgan Global Credit Index (GCI) ESG Investment Grade GBP Custom Maturity Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	"	J.P. Morgan ESG Emerging Market Bond Index (EMBI) Global Diversified Short-Term Custom Maturity Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G China CNY Bond UCITS ETF ⁴	"	J.P. Morgan China Custom Liquid ESG Capped Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	"	J.P. Morgan Global Credit Index (GCI) ESG Investment Grade USD Custom Maturity Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	"	J.P. Morgan ESG Corporate Emerging Market Bond Index (CEMBI) Broad Diversified Custom Maturity Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	"	Solactive Hydrogen Economy Index NTR	Legal & General Investment Management Limited

² Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 25. Januar 2019 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an den Fonds ausgegeben.

³ Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

⁴ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 22. Oktober 2020 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an den Fonds ausgegeben.

⁵ Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

Name des Fonds	Fondsart	Indexname	Anlageverwalter / Unteranlageverwalter
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	"	FTSE Developed Europe ex UK All Cap ex CW ex TC ex REITS Dividend Growth with Quality Net Tax Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	"	FTSE Emerging All Cap ex CW ex TC ex REITS Dividend Growth with Quality Net Tax Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	"	FTSE Developed Asia Pacific ex Japan All Cap ex CW ex TC ex REITS Dividend Growth with Quality Net Tax Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Digital Payments UCITS ETF	"	Solactive Digital Payments Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	"	J.P. Morgan India Government Fully Accessible Route (FAR) Bonds Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF ⁷	"	Solactive EPIC Optical Technology & Photonics Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF ⁸	"	Solactive L&G Global Thematic Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ⁸	"	iStoxx Access Metaverse Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ⁸	"	Solactive Emerging Cyber Security Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ⁹	"	Foxberry Sustainability Consensus Pacific ex Japan Total Return Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ⁹	"	Foxberry Sustainability Consensus Japan Total Return Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF ¹¹	"	Solactive Gerd Kommer Multifactor Equity Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	"	Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return	Legal & General Investment Management Limited
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	"	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	"	Barclays Backwardation Tilt Multi-Strategy Capped Total Return Index	Legal & General Investment Management Limited

⁷ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

⁸ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

⁹ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

¹⁰ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an dem Fonds ausgegeben.

¹¹ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

¹² Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 23. Februar 2017 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an den Fonds ausgegeben.

Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

Anlageziel und Anlagestrategie der Fonds

Alle Fonds streben, sofern nicht anders angegeben, eine Rendite entsprechend der Rendite eines Finanzindex an.

In Abhängigkeit von der Art des maßgeblichen Index, der vom jeweiligen Fonds nachgebildet/repliziert wird, kann der Anlageverwalter (bzw. der jeweilige Untermanagementverwalter) alternative Techniken anwenden, um ein Engagement im Index zu erzielen. Hierfür kommen insbesondere folgende Techniken in Frage:

- das Eingehen von derivativen Finanzinstrumenten (insbesondere Total Return Swaps) mit einem oder mehreren Kontrahenten;
- direkte Anlage in dem Portfolio von Wertpapieren oder anderen relevanten Vermögenswerten, die Komponenten des maßgeblichen Index sind; und/oder
- direkte Anlage in einer optimierten/repräsentativen Stichprobe der Indexkomponenten zusammen mit anderen zulässigen Vermögenswerten, die gegebenenfalls keinen Bezug zu den Indexkomponenten haben.

Die tatsächliche Methode, die ein Fonds anwendet, um seinen Index nachzubilden, ist in der Anlagestrategie des betreffenden Fonds im fondsspezifischen Nachtrag zum Verkaufsprospekt der Gesellschaft beschrieben.

Zur Klarstellung wird darauf hingewiesen, dass Total Return Swaps nur mit zulässigen Kontrahenten eingegangen werden, die einer bankaufsichtlichen Überwachung unterliegen und den von der Zentralbank zugelassenen Kategorien angehören. Nähere Einzelheiten zu den Zulassungskriterien für Finanzkontrahenten sind dem Abschnitt „Eignung von Kontrahenten“ im Verkaufsprospekt der Gesellschaft zu entnehmen.

In nachstehender Tabelle sind die Wertpapierbörsen aufgeführt, an denen die einzelnen Fonds (bzw. deren Anteilsklassen, sofern sich der betreffende Fonds aus mehr als einer Anteilklasse zusammensetzt) am 30. Juni 2023 notiert waren.

Fonds/Anteilklasse	Deutsche Börse Extra	Euronext Amsterdam	Borsa Italiana	London Stock Exchange	SIX Swiss Exchange	Euronext Paris	Bolsa Mexicana
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓	X	X
L&G Gold Mining UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓	X	X
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓	X	✓
L&G Cyber Security UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓	X	✓
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓	X	✓

Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Deutsche Börse Extra	Euronext Amsterdam	Borsa Italiانا	London Stock Exchange	SIX Swiss Exchange	Euronext Paris	Bolsa Mexicana
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓	X	X
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓	X	X
L&G Clean Water UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹	✓	X	✓	✓	X	X	X
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹	✓	X	✓	✓	X	X	X
L&G Clean Energy UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	✓
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	X	X	X	✓	✓	X	X
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	X	X	X	✓	✓	X	X
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF	✓	X	✓	X	✓	X	X
L&G China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G China CNY Bond UCITS ETF - EUR Distributing ETF ²	✓	X	X	X	X	X	X
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	X	X	X	✓	✓	X	X
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - EUR Hedged Accumulating ETF	X	X	X	X	✓	X	X
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Accumulating ETF	X	X	X	X	✓	X	X
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - GBP Hedged Distributing ETF	X	X	X	✓	X	X	X
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Distributing ETF	X	X	X	X	✓	X	X
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	✓
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	✓	X	✓	✓	X	X	X
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	✓	X	✓	✓	X	X	X
L&G Digital Payments UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X

²Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Deutsche Börse Extra	Euronext Amsterdam	Borsa Italiانا	London Stock Exchange	SIX Swiss Exchange	Euronext Paris	Bolsa Mexicana
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF - GBP Hedged Accumulating	X	X	X	✓	X	X	X
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	✓	X	X	✓	X	X	X
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF ¹	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF ²	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ²	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ²	✓	X	✓	✓	✓	X	X
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³	✓	X	X	✓	✓	X	X
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³	✓	X	X	✓	✓	X	X
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁴	✓	X	X	X	X	X	X
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF - USD Distributing ETF ⁴	✓	X	X	X	X	X	X

¹Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

²Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

³Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

⁴Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Jeder Fonds kann mehr als eine ihm zugeordnete Anteilklasse haben. Die Anteile jeder Anteilklasse in einem Fonds sind untereinander in jeder Hinsicht gleichrangig, mit den nachfolgend genannten oder vom Verwaltungsrat anderweitig festgelegten Ausnahmen:

- Währung, auf die die Anteile lauten
- Ausschüttungspolitik
- Gesamtkostenquote
- Mindestzeichnungs- und -rücknahmevermögen
- Währungsabsicherungspolitik

Die Bezeichnung „Fonds“ bezieht sich entweder auf einen Fonds der Gesellschaft oder kontextabhängig auf die Gesellschaft oder die Verwaltungsgesellschaft (oder deren Delegierte) für das Portfolio des jeweiligen Fonds.

Die Bezeichnung „NIW“ steht für Nettoinventarwert.

Die Bezeichnung „Verwaltungsgesellschaft“ bezieht sich auf die LGIM Managers (Europe) Limited.

Die Bezeichnung „globale Vertriebsstelle“ bezieht sich auf die Legal & General Investment Management Limited.

Die Bezeichnung „Anlageverwalter“ bezieht sich kontextabhängig auf die Legal & General Investment Management Limited.

Die Bezeichnung „Unteranlageverwalter“ bezieht sich auf die E Fund Management (Hong Kong) Co., Limited.

Die Bezeichnung „LGIMH“ bezieht sich auf die Legal & General Investment Management (Holdings) Limited.

Die Bezeichnung „L&G Unternehmensgruppe“ bezieht sich auf alle verbundenen Gesellschaften der Legal & General Group plc.

Die Bezeichnung „für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023“ bezieht sich auf den zwölfmonatigen Berichtszeitraum vom 1. Juli 2022 bis zum 30. Juni 2023.

Die Bezeichnung „Aktie“ oder „Aktien“ bezieht sich auch auf Stammaktien.

Die Bezeichnung „Verwalter“ bezieht sich auf die BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company.

Die Bezeichnung „Verwahrstelle“ bezieht sich auf The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch.

Fondsbericht

Die Wertentwicklung der Fonds im Berichtsjahr stellt sich wie folgt dar:

Die angegebenen Renditen sind die Renditen für die primäre Anteilklasse der einzelnen Fonds, nach Abzug von Gebühren, die als repräsentative Anteilklasse ausgewählt wurden. Die primäre Anteilklasse ist die Anteilklasse, in die die Mehrheit der Anleger des Fonds investiert hat, oder die Anteilklasse, wenn der entsprechende Fonds aus nur einer Anteilklasse besteht. Renditen für alle übrigen Anteilklassen stehen auf Anfrage zur Verfügung.

Anteilklasse	Währung	Auflegungsdatum	TER	NIW zum 30. Juni 2023 Gesamt	NIW zum 30.06.2023 Je Anteil	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2023 NIW/Anteil Veränderung in %	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2023 Indexveränderung in %	Nachbildungsabweichung in %	Erwarteter Tracking Error	Realisierter Tracking Error	Differenz zwischen dem erwarteten Tracking Error und dem realisierten Tracking Error in Basispunkten
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	15.03.2010	0,30 %	451.524.766	21,4964	-6,04 %	-5,70 %	-0,34 %	0,20 %	0,09 %	11,12
L&G Gold Mining UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	11.09.2008	0,65 %	130.150.606	29,7412	15,66 %	16,19 %	-0,53 %	0,35 %	0,17 %	17,61
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	12.05.2014	0,25 %	34.114.240	5,1351	22,83 %	24,09 %	-1,26 %	0,20 %	0,13 %	7,45
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	23.10.2014	0,80 %	1.044.049.186	23,3277	30,11 %	30,91 %	-0,80 %	0,45 %	0,09 %	36,18
L&G Cyber Security UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	22.09.2015	0,69 %	2.523.150.526	20,6806	10,69 %	11,66 %	-0,97 %	0,45 %	0,14 %	30,88
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	18.01.2018	0,49 %	1.043.928.805	19,7425	36,42 %	37,31 %	-0,89 %	0,45 %	0,20 %	25,47
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	18.01.2018	0,49 %	46.560.348	10,8117	-1,30 %	-0,94 %	-0,36 %	0,35 %	0,14 %	20,90
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	18.01.2018	0,49 %	254.539.630	15,2794	17,14 %	17,98 %	-0,84 %	0,45 %	0,25 %	19,77

Fondsbericht (Fortsetzung)

Anteilklasse	Währung	Auflegungsdatum	TER	NIW zum 30. Juni 2023 Gesamt	NIW zum 30.06.2023 Je Anteil	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2023 NIW/Anteil Veränderung in %	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2023 Indexveränderung in %	Nachbildungsabweichung in %	Erwarteter Tracking Error	Realisierter Tracking Error	Differenz zwischen dem erwarteten Tracking Error und dem realisierten Tracking Error in Basispunkten
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	25.06.2019	0,49 %	444.679.042	15,5346	20,37 %	21,09 %	-0,71 %	0,45 %	0,14 %	31,41
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	26.06.2019	0,49 %	410.941.069	15,7790	35,80 %	36,18 %	-0,38 %	0,45 %	0,20 %	24,54
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	26.06.2019	0,49 %	123.316.047	12,4247	4,18 %	4,32 %	-0,14 %	0,45 %	0,11 %	34,26
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - EUR Accumulating ETF ⁵	EUR	30.08.2019	0,16 %	394.750.568	13,7742	17,28 %	17,14 %	0,14 %	0,30 %	0,13 %	17,44
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁵	US\$	26.11.2019	0,12 %	1.355.141.536	15,3695	20,90 %	20,74 %	0,16 %	0,30 %	0,03 %	27,08
L&G Clean Energy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	05.11.2020	0,49 %	213.422.628	11,3211	11,93 %	6,75 %	5,17 %	0,35 %	5,66 %	-531,11
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF ²	GBP	03.12.2020	0,09 %	95.039.635	9,0661	-2,05 %	-1,68 %	-0,36 %	1,00 %	0,14 %	85,86
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF - GBP Distributing ETF ²	GBP	03.12.2020	0,09 %	106.721.952	7,6573	-6,57 %	-6,06 %	-0,51 %	1,00 %	0,20 %	80,04
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	03.12.2020	0,25 %	211.249.662	8,6681	4,66 %	5,26 %	-0,60 %	1,00 %	0,27 %	72,72
L&G China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ^{2,6}	US\$	03.12.2020	0,30 %	136.959.617	9,4404	-4,67 %	-4,36 %	-0,31 %	1,00 %	0,13 %	87,26
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	15.01.2021	0,09 %	122.247.044	8,4590	1,67 %	1,62 %	0,05 %	1,00 %	0,19 %	80,70
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	15.01.2021	0,35 %	174.252.468	8,4611	3,89 %	4,91 %	-1,02 %	1,00 %	0,24 %	75,85
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁴	US\$	01.02.2021	0,49 %	534.389.498	5,1423	-4,80 %	-5,55 %	0,75 %	0,45 %	0,86 %	-40,77

Fondsbericht (Fortsetzung)

Anteilklasse	Währung	Auflegungsdatum	TER	NIW zum 30. Juni 2023 Gesamt	NIW zum 30.06.2023 Je Anteil	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr		Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2023		Erwarteter Tracking Error	Realisierter Tracking Error	Differenz zwischen dem erwarteten Tracking Error und dem realisierten Tracking Error in Basispunkten
						Veränderung in %	30.06.2023 NIW/Anteil	Indexveränderung in %	Nachbildungsabweichung in %			
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF - EUR Distributing ETF ²	EUR	12.04.2021	0,25 %	29.214.282	10,2234	16,96 %	16,16 %	16,16 %	0,80 %	0,35 %	0,39 %	-4,42
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	12.04.2021	0,40 %	21.343.014	8,2724	3,19 %	3,60 %	3,60 %	-0,41 %	0,35 %	0,11 %	24,19
L&G Digital Payments UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	25.05.2021	0,49 %	23.255.348	6,6729	17,99 %	18,03 %	18,03 %	-0,04 %	0,35 %	0,44 %	-8,89
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	02.07.2021	0,30 %	1.679.221.354	13,1224	-6,10 %	-5,61 %	-5,61 %	-0,49 %	0,20 %	0,11 %	9,27
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	12.07.2021	0,45 %	17.809.948	8,8547	11,10 %	12,26 %	12,26 %	-1,16 %	0,75 %	0,31 %	43,99
L&G India INR Government Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	26.10.2021	0,39 %	387.008.056	9,0676	4,54 %	5,37 %	5,37 %	-0,83 %	1,00 %	0,18 %	82,17
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	US\$	02.09.2022	0,49 %	3.701.493	10,5756	9,79 %	10,37 %	10,37 %	-0,58 %	0,35 %	0,06 %	29,34
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	US\$	02.09.2022	0,60 %	3.800.991	11,0493	12,53 %	13,22 %	13,22 %	0,00 %	0,35 %	0,18 %	16,55
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	US\$	02.09.2022	0,39 %	2.619.847	12,7797	32,09 %	32,26 %	32,26 %	-0,17 %	0,35 %	0,08 %	27,36
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	US\$	02.09.2022	0,49 %	7.810.579	10,8480	13,91 %	14,26 %	14,26 %	-0,35 %	0,35 %	0,05 %	29,87
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	US\$	20.10.2022	0,16 %	3.881.330	11,3821	16,27 %	16,30 %	16,30 %	-0,03 %	0,30 %	0,11 %	18,84
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	US\$	20.10.2022	0,16 %	4.178.315	12,1914	24,17 %	24,88 %	24,88 %	-0,71 %	0,30 %	0,30 %	-0,10
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF ^{1,9}	US\$	15.06.2023	0,50 %	11.012.963	10,1128	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,35 %	n. zutr.	n. zutr.

¹ Angaben zu NIW und Wertentwicklung beziehen sich auf den Berichtszeitraum vom angegebenen Auflegungsdatum der einzelnen Anteilklassen bis zum 30. Juni 2023.

² Die Wertentwicklung ist Total Return mit am Ex-Datum reinvestierten Dividenden.

³ Der tatsächliche Tracking Error entspricht nicht dem erwarteten Tracking Error.

⁴ Der tatsächliche Tracking Error wird jährlich ausgewiesen.

UCITS ETF ihre Namen in L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF bzw. L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF.

⁶ Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

⁹ Da der Fonds noch keinen Monat besteht, können wir zu diesem Zeitpunkt keinen aussagekräftigen Tracking Error berechnen.

Fondsbericht (Fortsetzung)

Der tatsächliche Tracking Error entspricht nicht dem erwarteten Tracking Error

L&G Clean Energy UCITS ETF

Die positive Nachbildung in diesem Berichtszeitraum war eine teilweise Umkehrung des vorherigen negativen Tracking Errors des Fonds im Zusammenhang mit einer Kapitalmaßnahme bei Saipem.

Der Index implementierte dieses Ereignis durch vollumfänglichen Erwerb der zusätzlichen Aktien aus der Bezugsrechtsemission am Ex-Tag 27. Juni 2022. Der Fonds dagegen entschied sich für eine Aufnahme der Bezugsrechte am 11. Juli 2022. Aus der Perspektive des Fonds stellt eine Bezugsrechtsemission am Ex-Tag eine Option zur Ausübung dieser Bezugsrechte dar. Je nach Marktpreisentwicklung kann der Fonds diese Rechte ausüben, verfallen lassen oder auch verkaufen. Dementsprechend hat sich das Indexgewicht von Saipem ab dem 27. Juni 2022 wesentlich erhöht.

Aus Gründen der Terminierung und der unterschiedlichen Behandlung der Bezugsrechte durch den Index und den Fonds war aus der Perspektive des Fonds eine perfekte Nachbildung nicht implementierbar. Dieser Behandlungsunterschied zwischen dem Fonds und dem Index führte zu einer Performance-Abweichung zwischen dem Fonds und dem Index zwischen dem 27. Juni 2022 und dem 15. Juli 2022, da der Fonds in diesem Zeitraum in Saipem unterinvestiert war.

Die Performance-Abweichung wurde wieder ausgeglichen, und die Indexnachbildung durch den Fonds entsprach wieder den Erwartungen, als die neu emittierten Aktien am 15. Juli 2022 im Fonds eingebucht wurden.

L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

Aufgrund einer untergewichteten Position in Uniper nach einer Streichung aus dem Index. Dieses Wertpapier wurde aus dem Index genommen, da eine Verstaatlichung des Unternehmens bevorstand. Die untergewichtete Position entstand, da wir nach der vorherigen Neugewichtung vor der Streichung aus dem Index das Wertpapier weiter zukaufen, was zu einer Outperformance führte, da die Aktie in diesem Zeitraum im Kurs fiel.

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF

Der unterschiedliche Tracking Error ist größtenteils auf die unterschiedliche Quellensteuer zwischen dem Fonds und dem Index zurückzuführen, da der Fonds günstigere Sätze hat und deshalb besser abschneidet. Dies wurde insbesondere im Mai deutlich, in dem viele deutsche Unternehmen Dividenden auszahlen. Der Fonds verbucht diese mit 15 % Quellensteuer, während der Index sie mit 26,5 % berücksichtigt. Folglich hat der Fonds den Index positiv mit einem Plus von mehr als 40 Basispunkten in einem Monat nachgebildet.

L&G Digital Payments UCITS ETF

Der Fonds hat Qiwi plc im November 2022 verkauft. Diese Aktie unterlag Sanktionen und wurde ab März 2022 mit einem beizulegenden Zeitwert von null bewertet. Der Fonds schaffte es, die Aktie zu verkaufen, und konnte etwas vom Wert in den Fonds zurückführen. Die damit verbundene positive Nachbildung führte dazu, dass der erwartete Tracking Error den angegebenen Ex-post-Tracking Error überstieg.

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF

Dieser Fonds wurde auf niedrigen Niveaus des verwalteten Vermögens optimiert. Einige der untergewichteten Wertpapierpositionen lieferten eine deutliche Outperformance gegenüber dem Index.

Fondsbericht (Fortsetzung)

Fonds mit synthetischer Nachbildung: Die Tracking Difference (d. h. die Nachbildungsabweichung in Bezug auf die Performance eines jeden Fonds und die Performance des entsprechenden Index) ist durch die Portfoliotransaktionskosten bedingt, die dem Fonds im Zusammenhang mit außerbörslich gehandelten Swaps (OTC-) abgezogen werden, welche mit Kontrahenten abgeschlossen werden, um die Performance der entsprechenden Indizes nachzubilden, sowie durch die Gesamtkostenquote (TER), die dem Fonds abgezogen und an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt wird. Den jeweils von den Fonds nachgebildeten Indizes entstehen keine der vorstehend aufgeführten Kosten und Gebühren. Daher werden die einzelnen Fonds in dieser Hinsicht stets vom entsprechenden Index abweichen. Jeder Fonds hat eine andere Verwaltungsgebühr und einen anderen Swap Spread. Daher variieren die Zahlen zur Nachbildungsabweichung zwischen den einzelnen Fonds. So haben beispielsweise 2x-Short- und 2x-Leveraged-Fonds in der Regel höhere Swap Spreads und damit eine höhere Nachbildungsabweichung.

Der Tracking Error (d. h. die Volatilität der Abweichungen zwischen der Rendite des Fonds und der Rendite des entsprechenden Index) in diesen Fonds lässt sich auf die Über- bzw. Untergewichtung des Swap-Kontraktes, die nur dann angepasst werden kann, wenn Handelsgeschäfte getätigt werden oder zu den monatlichen Reset-Daten, und der Swapabgrenzungen, die zum monatlichen Reset-Datum festgesetzt werden und im Laufe des Monats nicht zur Berücksichtigung von Änderungen des NIW des Fonds aktualisiert werden, zurückführen. Die Höhen der erwarteten Tracking Error gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft spiegeln die erwarteten Höhen „unter normalen Marktbedingungen“ wider. Aufgrund der seit Februar 2020 gestiegenen Volatilität auf den Märkten haben die oben genannten Faktoren an Wesentlichkeit gewonnen, und in einigen Fällen haben die Fonds einen Tracking Error erzielt, der größer ist als die gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft erwartete Höhe.

Fonds mit physischer Nachbildung: Die Tracking Difference (d. h. die Nachbildungsabweichung in Bezug auf die Performance eines jeden Fonds und die Performance des entsprechenden Index) ist durch die Portfoliotransaktionskosten bedingt, die dem Fonds im Zusammenhang mit dem Kauf und Verkauf von Anlagen als Teil der Indexnachbildungsstrategie abgezogen werden, sowie durch die Gesamtkostenquote (TER), die dem Fonds abgezogen und an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt wird. Den jeweils von den Fonds nachgebildeten Indizes entstehen keine der vorstehend aufgeführten Kosten und Gebühren. Daher werden die einzelnen Fonds in dieser Hinsicht stets vom entsprechenden Index abweichen. Darüber hinaus setzen die Fonds eine optimierte /repräsentative Stichprobenstrategie ein, d. h. sie halten nicht alle der sich in ihren jeweiligen Indizes befindenden zugrunde liegenden Komponenten. Dementsprechend kann die Strategie bewirken, dass ein Fonds über einen bestimmten Zeitraum im Vergleich zu seinem jeweiligen Index Über- oder Unterrenditen erzielt.

Der Tracking Error (d. h. die Volatilität der Abweichungen zwischen der Rendite des Fonds und der Rendite des entsprechenden Index) in diesen Fonds lässt sich auf die unterschiedliche Behandlung steuerlicher Abgaben zwischen den Fonds und dem entsprechenden Index sowie auf Nachbildungsabweichungen, bei denen der Fonds nicht genau die Zusammensetzung des entsprechenden Index widerspiegelt, zurückführen. Die Höhen der erwarteten Tracking Error gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft spiegeln die erwarteten Höhen „unter normalen Marktbedingungen“ wider. Aufgrund der seit Februar 2020 gestiegenen Volatilität auf den Märkten sind die Auswirkungen von Nachbildungsabweichungen größer geworden und haben dazu geführt, dass die realisierten Tracking Error einiger Fonds größer sind als die gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft erwarteten.

Fondsbericht (Fortsetzung)

Marktkommentar – Juni 2023

Wirtschaftlicher Überblick

In den vergangenen 12 Monaten wurden die Gedanken der Marktteilnehmer weiterhin von dem Inflationsdruck und einer strafferen Geldpolitik dominiert. Die Befürchtungen einer Konjunkturabkühlung bleiben das vorrangige Thema von Anlegern, und angesichts Anzeichen für einen Inflationsgipfel in mehreren Industrieländern gibt es sogar sehr vorsichtige Spekulationen, wann Zentralbanken von Industrieländern Zinssenkungen starten könnten.

In den USA hat die US-Notenbank Federal Reserve (die „Fed“) ihre geldpolitische Straffung fortgesetzt. Nachdem sie die Zinsen jedoch von fast null auf zwischen 5 % und 5,25 % in nur etwas über einem Jahr angehoben hat, pausierte die Fed ihre Zinserhöhungen im Juni. Der Fed-Vorsitzende Jay Powell nannte diesen Schritt angesichts von Tempo und Umfang der von der Zentralbank in den letzten 15 Monaten durchgeführten Zinserhöhungen „umsichtig“. Die annualisierte US-Inflation stieg im Mai im langsamsten Tempo seit mehr als zwei Jahren auf 4 %.

Die Bank of England (die „BoE“) erhöhte weiter die Zinsen in den sechs Monaten, die im Juni unglaubliche 5 % erreichten, ihre 13. Zinserhöhung in Folge, wodurch die Zinsen auf ihren höchsten Stand seit 2008 anstiegen. Indessen blieb die Inflation mit 8,7 % im Mai hartnäckig hoch.

Die Zeiten weit verbreiteter Wertpapierkaufprogramme der Zentralbanken scheinen ihrem Ende entgegenzugehen. Lediglich die Bank of Japan scheint die letzte Bastion dieser Politik zu sein, und selbst sie intervenierte in der Mitte des Berichtszeitraums, um den Renditen der 10-jährigen Staatsanleihe größeren Spielraum zu geben. Im September ließ das erste (und letzte) „Mini Budget“ des Vereinigten Königreichs unter der Amtszeit des britischen Schatzkanzlers Kwasi Kwarteng, das eine Reihe umfangreicher ungedeckter Ausgabenversprechen enthielt, die Renditen britischer Staatsanleihen (Gilts) in die Höhe schnellen und das britische Pfund gegenüber dem US-Dollar auf seinen niedrigsten Stand seit fast 40 Jahren fallen.

Kwartengs Amtszeit erwies sich als kurzlebig. Premierministerin Liz Truss trat nach nur 50 Tagen im Amt zurück. Im Anschluss wurde Rishi Sunak von den konservativen Abgeordneten im Parlament in kürzester Zeit zu seinem Nachfolger gewählt. Er ist damit der dritte britische Premierminister in nur zwei Monaten. Die Aussicht auf eine verantwortungsvollere Finanzpolitik führte dazu, dass die Renditen britischer Staatsanleihen (Gilts) gegenüber ihren Höchstständen vom September deutlich zurückgingen. Da die Inflation allerdings immer noch hartnäckig hoch ist und eine Beendigung des Zinserhöhungszykluses der BoE scheinbar nicht in Sicht ist, stiegen die Renditen, um dieselben unglaublichen Höhen gegen Ende des Jahres zu erreichen.

In Europa hob die Europäische Zentralbank (die „EZB“) die Zinsen im Berichtszeitraum weiter an. Nach ihren Zinserhöhungen um 50 Basispunkte im Dezember, Februar und März hob sie dann die Zinsen im Mai und Juni um jeweils 25 Basispunkte auf 4 % an, was dem Allzeithoch der EZB vom Jahr 2001 entspricht. Die EZB-Präsidentin Christine Lagarde warnte, dass mit einer weiteren Zinserhöhung im Juli zu rechnen sei und die Zentralbank „noch viel vor habe“. Die annualisierte Inflation der Eurozone ging auf 5,5 % im Juni zurück, ihr niedrigster Stand seit Anfang 2022.

Anderorts war die Silicon Valley Bank* ein namhaftes US-Opfer der Probleme im Bankensektor, die Ende Februar auftraten, obwohl das Ansteckungsrisiko scheinbar gut eingedämmt war. Indessen half die Schweizer Aufsichtsbehörde, eine schnelle Übernahme der angeschlagenen Credit Suisse* einzuleiten, und ihr Kontrahent UBS* sprang zur Rettung des angeschlagenen Unternehmens in einer reinen Aktientransaktion zu einem stark reduzierten Preis ein.

In der Zwischenzeit waren die Auswirkungen des russischen Einmarschs in der Ukraine im Februar 2022 weiterhin in diesem Jahr mit anhaltenden Befürchtungen einer globalen geopolitischen Krise zu erleben, während die Auswirkungen auf den Energiesektor und für die Energiekunden unvermindert zu spüren sind.

Aktien

Trotz einiger deutlich volatiler Monate in der Mitte des Berichtszeitraums stiegen globale Aktienindizes im vergangenen Jahr kräftig in US-Dollar, selbst als anhaltende Inflationssorgen, eine zunehmend straffere Geldpolitik in Industrieländern und Rezessionsängste zu Buche schlugen.

Fondsbericht (Fortsetzung)

Aktien (Fortsetzung)

Vor diesem Hintergrund verbuchten britische Aktien eine positive Rendite in Pfund Sterling, blieben allerdings hinter dem globalen Durchschnitt zurück. Es gab starke Ergebnisse aus den Sektoren Technologie, Industrie und Nicht-Basiskonsumgüter, aber diese Wertentwicklungen wurden größtenteils durch enttäuschende 12 Monate für die Sektoren Telekommunikation, Immobilien und Grundstoffe kompensiert.

Die US-Aktienmärkte lieferten eine kräftige Rendite für die 12 Monate und übertrafen den globalen Durchschnitt in US-Dollar. Im vergangenen Jahr glich die herausragende Performance der Technologie einher mit soliden Ergebnissen der Sektoren Kommunikationsdienstleistungen, Grundstoffe und Energie anderweitige schwache Ergebnisse mehr als aus. Immobilien und Versorger waren die einzigen Marktbereiche, die im Jahresverlauf an Boden verloren.

Europäische Aktien verbuchten kräftige Gewinne im Verlauf der 12 Monate und übertrafen den globalen Durchschnitt in Euro. Nach der über den Großteil des Jahres erlebten kräftigen Volatilität erfolgte die Erholung. Die Auswirkung des russischen Einmarschs in die Ukraine schadete der Anlageklasse in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums. Auf Sektorebene war die allgemeine Industrie der herausragende Performer, wobei es auch sehr gute Wertentwicklungen in den Sektoren Reise und Freizeit, allgemeine Industrie, Nicht-Basiskonsumgüter, Technologie und Banken gab. Auf der negativen Seite erlebte der Immobiliensektor eine deutliche Durststrecke und bildete das Schlusslicht, während die Telekommunikation die 12 Monate ebenfalls mit Verlust beendete.

Die Aktienmärkte des asiatisch-pazifischen Raums haben in den letzten 12 Monaten in US-Dollar an Boden verloren und gegenüber den globalen Aktienmärkten eine Underperformance verzeichnet. Die Verpflichtung Chinas zu einer „Null-COVID-Politik“ belastete den chinesischen Aktienmarkt in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums stark, während das Land auch mit einem angeschlagenen Immobiliensektor und den allgemein vorherrschenden Sorgen um das Wirtschaftswachstum kämpfte. Chinesische Aktien zogen jedoch kurzfristig an, nachdem Peking eine Lockerung seiner Pandemiebeschränkungen zur Jahreswende ankündigte, was als Anzeichen für ein Ende der chinesischen „Null-Covid-Politik“ angesehen wurde, einher mit einer Reihe von Unterstützungsmaßnahmen für seinen angeschlagenen Immobiliensektor. Dennoch verloren chinesische Aktien deutlich an Boden im Gesamtjahr und blieben gegen Ende erneut aufgrund von Sorgen zurück, dass seine Post-Pandemie-Erholung nicht nachhaltig sein könnte. Indien erlebte bessere 12 Monate und beendete diese deutlich im Plus.

Schwellenländer erlebten schwierige 12 Monate und verloren in US-Dollar an Boden. Der allgemeine Rückgang der Schwellenländeraktien im Verlauf des Jahres verschleierte erhebliche Unterschiede zwischen den einzelnen Ländern, aus denen sich der Index zusammensetzt. Wie bereits erwähnt kam es in China aufgrund von Befürchtungen einer Konjunkturabkühlung und wegen regulatorischer Bedenken zu massiven Ausverkäufen, Indien schloss im Plus, Brasilien verbuchte indessen kräftige Gewinne in den 12 Monaten.

Anleihen

Die Renditen auf Staatsanleihen aus Industrieländern sind im Berichtszeitraum kräftig gestiegen (und die Kurse gefallen). Die Renditen stiegen beständig im Berichtszeitraum, da der Inflationsdruck und geldpolitische Straffungsmaßnahmen erneut die Zügel in der Hand hatten. Die Rendite auf die 10-jährige US-Staatsanleihe und die deutsche Bundesanleihe stieg insgesamt kräftig in den 12 Monaten, obwohl ihr Anstieg durch die relativen Renditebewegungen der britischen Staatsanleihe (Gilt) und der japanischen Staatsanleihe überschattet wurde.

Die Auswirkungen des „Mini Budgets“ der britischen Regierung auf die Renditen britischer Staatsanleihen waren in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums besonders deutlich, als die Rendite auf die 10-jährige Staatsanleihe allein im September 2022 um horrende 120 Basispunkte angestiegen ist. Die Renditen gingen dann allerdings anschließend wieder deutlich zurück. Gegen Ende des Jahres stiegen die Renditen angesichts einer immer noch hartnäckig hoch bleibenden Inflation und einer Beendigung des Zinserhöhungszykluses scheinbar nicht in Sicht erneut, um diese Höchststände vom September anzutasten. Indessen stieg die Rendite auf die 10-jährige japanische Staatsanleihe deutlich in der Mitte des Berichtszeitraums infolge einer Ankündigung seitens der Bank of Japan, dass sie ihre Maßnahmen zur Kontrolle der Renditekurve anpasse, so dass Renditen sich um 0,5 % – zuvor 0,25 % – bewegen können.

Fondsbericht (Fortsetzung)

Anleihen (Fortsetzung)

Die Spreads von Anleihen mit Investment Grade in den USA, im Vereinigten Königreich und in Europa folgten über den Großteil des Berichtszeitraums den Renditen der zugrunde liegenden Staatsanleihen, wobei die bei Renditen britischer und europäischer Investment-Grade-Anleihen erlebten Bewegungen gegen Ende des Berichtszeitraums zumeist ausgeprägter als bei ihren US-Pendants waren. Im Verlauf der gesamten 12 Monate kam es jedoch zu einer allgemeinen Spread-Verengung. Auch die Spreads von Hochzinsanleihen verengten sich im Verlauf des Gesamtjahres.

Immobilien

Aufgrund eines schwierigen Hintergrunds volatiler Finanzierungskosten lavierte sich der britische Markt für Gewerbeimmobilien durch den Berichtszeitraum. Indessen war im vergangenen Jahr ein anhaltender allmählicher Aufwärtstrend bei der Belegung von Büroimmobilien zu verzeichnen, die derzeit zwischen 30 % und 35 % schwankt, während Investitionsvolumen sich gegen Ende des Berichtszeitraums abschwächten. Auch die Volumen der Einzelhandelsumsätze wurden gegen Ende des Jahres 2022 schwächer. Zu guter Letzt setzte der britische Markt für Wohnimmobilien angesichts weiter steigender Zinsen seine Schwächephase fort. Der Nationwide House Price Index gab im Jahr bis Juni 3,5 % ab.

August 2023

Bericht des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat legt seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr vor.

Einleitung

Als Emittent von börsengehandelten Indexfonds (ETFs) hat die Gesellschaft die Struktur eines Umbrellafonds und setzt sich aus einer Reihe von separaten Fonds mit getrennter Haftung zwischen den einzelnen Fonds zusammen. Das Hauptziel der Gesellschaft besteht in der gemeinsamen Anlage von auf dem Kapitalmarkt aufgebracht Geldern gemäß den speziellen Anlagezielen/Anlagestrategien der einzelnen Fonds, die vom Verwaltungsrat zum Zeitpunkt der Auflegung des Fonds festgelegt und im Verkaufsprospekt der Gesellschaft und den fondsspezifischen Nachträgen dazu dargelegt werden. Die Anteile der einzelnen Fonds und jede ihrer Anteilklassen, sofern sie aus mehr als einer Anteilklasse bestehen, werden zu verschiedenen Bedingungen ausgegeben. Jede Änderung am Anlageziel eines Fonds und/oder jede wesentliche Änderung der Anlagestrategie eines Fonds bedarf der vorherigen Zustimmung der Anteilhaber der verschiedenen Anteilklassen des betreffenden Fonds.

Beschreibung der Obliegenheiten des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Berichts des Verwaltungsrats und die Aufstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit geltenden Gesetzen und Vorschriften verantwortlich.

Nach dem Companies Act 2014 ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jedes Geschäftsjahr einen Jahresabschluss zu erstellen. Der Jahresabschluss wurde gemäß internationalen Bilanzierungsgrundsätzen (International Financial Reporting Standards), wie sie in der Europäischen Union anzuwenden sind („EU-IFRS“), sowie nach den anwendbaren Gesetzen aufgestellt.

Nach dem irischen Gesellschaftsrecht kann der Verwaltungsrat den Jahresabschluss nur dann genehmigen, wenn er sich zu seiner Zufriedenheit vergewissert hat, dass der Abschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und Finanzlage der Gesellschaft und der Veränderungen des Nettovermögens, das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile in dem betreffenden Geschäftsjahr zuzurechnen ist, vermittelt. Bei der Erstellung dieser Abschlüsse ist der Verwaltungsrat gehalten:

- geeignete Bilanzierungsgrundsätze auszuwählen und diese konsequent anzuwenden;
- angemessene und vorsichtige Beurteilungen und Schätzungen abzugeben;
- anzugeben, ob der Abschluss gemäß EU-IFRS aufgestellt wurde und
- von der Fortführung der Gesellschaft auszugehen, es sei denn, die Annahme, dass die Gesellschaft fortgeführt wird, ist nicht angemessen.

Der Verwaltungsrat ist für eine ordnungsgemäße Buchführung verantwortlich, aus der jederzeit mit angemessener Genauigkeit die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die Finanzlage und der Gewinn oder Verlust der Gesellschaft zu ersehen ist und die es ihm ermöglicht, zu gewährleisten, dass der Abschluss den Bestimmungen des Companies Act 2014, der OGAW-Vorschriften sowie der OGAW-Vorschriften der Zentralbank entspricht. Dem Verwaltungsrat obliegt es generell, die ihm angemessenerweise zur Verfügung stehenden Maßnahmen zu ergreifen, um das Vermögen der Gesellschaft sicher zu verwahren. Zu diesem Zweck hat er die Vermögenswerte der Gesellschaft bei einer Verwahrstelle in Verwahrung gegeben. Er ist allgemein verpflichtet, angemessene ihm zur Verfügung stehende Maßnahmen zur Verhinderung und Aufdeckung von betrügerischen Handlungen und anderen Unregelmäßigkeiten zu treffen. Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat verpflichtet, einen Bericht des Verwaltungsrats zu erstellen, der den Anforderungen des Companies Act 2014 entspricht.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Beschreibung der Obliegenheiten des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Nach Kenntnis jeder Person, die zum Zeitpunkt der Genehmigung dieses Berichts Verwaltungsratsmitglied ist, liegen keine prüfungsrelevanten Informationen – also Informationen, die vom Abschlussprüfer im Zusammenhang mit der Erstellung seines Berichts benötigt werden – vor, die dem Abschlussprüfer nicht bekannt sind. Durch Erkundigungen bei Verwaltungsratskollegen und beim Abschlussprüfer der Gesellschaft haben alle Verwaltungsratsmitglieder sämtliche ihnen zukommenden Schritte unternommen, um Kenntnis von prüfungsrelevanten Informationen zu erlangen und sich zu vergewissern, dass den Abschlussprüfern der Gesellschaft diese Informationen bekannt sind.

Der Companies Act 2014 verlangt vom Verwaltungsrat sicherzustellen, dass der Jahresbericht und der Jahresabschluss in ihrer Gesamtheit ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes und ausgewogenes Bild vermitteln und die nötigen Informationen zur Verfügung stellen, um die Ergebnisentwicklung und die Strategie der Gesellschaft bewerten zu können. Um zu einer Aussage über diesen Sachverhalt zu gelangen, hat der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) den Prüfungsausschuss gebeten, mitzuteilen, ob der Jahresbericht und der Jahresabschluss diese Anforderungen seiner Auffassung nach erfüllen. Im Ergebnis ist der Verwaltungsrat zu dem Schluss gelangt, dass der Jahresbericht und der Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 in ihrer Gesamtheit fair, ausgewogen und verständlich sind und den Anteilinhabern die Informationen zur Verfügung stellen, um die Lage, die Ergebnisentwicklung, das Geschäftsmodell und die Strategie der Gesellschaft bewerten zu können.

Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Gesellschaftssekretärs

Weder der Verwaltungsrat noch Matsack Trust Limited (der „Gesellschaftssekretär“) noch ihre Familien hatten während der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023 bzw. 30. Juni 2022 noch am Bilanzstichtag direkt oder indirekt Beteiligungen an von der Gesellschaft ausgegebenen Anteilen.

Die Verwaltungsratsmitglieder, die im Geschäftsjahr im Amt waren, sind nachstehend aufgeführt. Die Biografien der einzelnen Verwaltungsratsmitglieder sind im Abschnitt C „Verwaltungsrat“ der Corporate-Governance-Erklärung enthalten.

Feargal Dempsey (Ire) ⁽¹⁾ ⁽²⁾

Howie Li (Brite)

Patrizia Libotte (Irin)

David Fagan (IRE) ⁽¹⁾

Donard McClean (IRE) ⁽¹⁾

⁽¹⁾ Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

⁽²⁾ Vorsitzender

Alle Verwaltungsratsmitglieder waren nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder.

Wo nicht anders angegeben, waren sie das gesamte Geschäftsjahr über im Amt.

Transaktionen unter Beteiligung von Verwaltungsratsmitgliedern

Dem Verwaltungsrat sind außer den in Anmerkung 8, Wesentliche Vereinbarungen und Transaktionen mit verbundenen Parteien, angegebenen keine wesentlichen Verträge oder Vereinbarungen im Zusammenhang mit dem Geschäft der Gesellschaft bekannt, an denen die Verwaltungsratsmitglieder zu irgendeinem Zeitpunkt während der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023 bzw. 30. Juni 2022 beteiligt gewesen wären, wie im irischen Companies Act von 2014 definiert.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Nach Section 225 des irischen Companies Act von 2014 geforderte Compliance-Erklärung des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat bestätigt, dass er für die Sicherstellung der Konformität der Legal & General UCITS ETF plc (nachstehend die „Gesellschaft“) mit ihren maßgeblichen Verpflichtungen gemäß Definition in Abschnitt 225 des Companies Act von 2014 (nachstehend die „maßgeblichen Verpflichtungen“ genannt) verantwortlich ist.

Die Verwaltungsratsmitglieder bestätigen, dass:

- (i) eine Entsprechenserklärung aufgesetzt worden ist, aus der die Richtlinien bezüglich der Erfüllung der maßgeblichen Verpflichtungen durch die Gesellschaft hervorgehen, die nach Auffassung des Verwaltungsrats für die Gesellschaft geeignet sind;
- (ii) angemessene Vorkehrungen getroffen oder Strukturen geschaffen wurden, die unseres Erachtens für die Sicherstellung konzipiert sind, dass die Gesellschaft ihre maßgeblichen Verpflichtungen im Wesentlichen erfüllt; und
- (iii) die Wirksamkeit der unter (ii) genannten Vorkehrungen oder Strukturen im Geschäftsjahr überprüft worden ist.

Corporate-Governance-Erklärung

A. Allgemeine Anforderungen

In dieser Erklärung werden die Corporate-Governance-Struktur und -Prozesse zusammengefasst, die von der Gesellschaft im Berichtsjahr angewandt wurden.

Der Verwaltungsrat hat den freiwilligen Corporate Governance Code für Organismen für gemeinsame Anlagen und Verwaltungsgesellschaften, der von der Irish Fund Industry Association im Dezember 2011 veröffentlicht wurde (der „IF-Code“), als Corporate Governance Code der Gesellschaft übernommen. Der Verwaltungsrat ist der Ansicht, dass die Gesellschaft die im Code enthaltenen Bestimmungen während des am 30. Juni 2023 endenden Geschäftsjahres eingehalten hat. Zusätzlich zu ihrer freiwilligen Einhaltung des IF-Code unterliegt die Gesellschaft Corporate-Governance-Praktiken, die ihr auferlegt werden von:

- I. dem irischen Companies Act 2014 (der „Companies Act“), der auf der Website des Irish Statute Book abrufbar ist: <http://www.irishstatutebook.ie>;
- II. der Satzung der Gesellschaft (die „Satzung“), die zur Einsichtnahme am eingetragenen Sitz der Gesellschaft sowie am eingetragenen Sitz des Verwalters sowie bei der Handelsregisterbehörde (Companies Registration Office) in Irland zur Verfügung steht;
- III. den OGAW-Vorschriften der Zentralbank, die derzeit auf der Website der Central Bank of Ireland unter <https://www.centralbank.ie/regulation/industry-market-sectors/funds/ucits> abrufbar sind;
- IV. den Börsenzulassungsregeln der United Kingdom Listing Authority (die UKLA-Börsenzulassungsregeln), insoweit sie für ausländische Investmentfonds gemäß Kapitel 16 der UKLA-Börsenzulassungsregeln sowie den maßgeblichen Kapiteln der Offenlegungsregeln und der Transparenzregeln (Disclosure Rules and Transparency Rules) der Financial Conduct Authority („FCA“) gelten, die nachzulesen sind auf: <http://fshandbook.info/FS/html/handbook/DTR>.

Jeder der von der Gesellschaft beauftragten Dienstleister unterliegt seinen eigenen Corporate-Governance-Anforderungen.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

B. Verwaltungsrat

1. Zusammensetzung des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat setzt sich derzeit aus fünf Verwaltungsratsmitgliedern zusammen, die alle nicht-geschäftsführend sind. Drei der Verwaltungsratsmitglieder sind unabhängig und fungieren als Berater („Sounding Boards“) des Vorsitzenden sowie bei Bedarf als Vermittler zwischen den übrigen Verwaltungsratsmitgliedern. Die drei unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder sind in Irland ansässige Personen und können bei Bedarf kurzfristig mit der Zentralbank zusammentreffen.

Die Verwaltungsratsmitglieder haben beträchtliche Erfahrungen in den Bereichen Finanz- und Investmentmanagement und verfügen zusammen über ein ausgewogenes Verhältnis von Fähigkeiten, Erfahrungen, Unabhängigkeit und Kenntnis der Gesellschaft, um ihre jeweiligen Pflichten und Aufgaben effizient ausüben zu können.

Es folgen Einzelheiten zu den derzeitigen Verwaltungsratsmitgliedern und ihren jeweiligen Fähigkeiten und Erfahrungen:

- Feargal Dempsey (irische Staatsangehörigkeit, Wohnsitz in Irland) – nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied und Vorsitzender – am 14. Januar 2020 in den Verwaltungsrat berufen

Herr Dempsey erbringt unabhängige Beratungs- und Verwaltungsratsdienste und hat mehr als 20 Jahre Erfahrung im Finanzdienstleistungsgeschäft. Er sitzt in den Verwaltungsräten mehrerer Investmentfonds und Verwaltungsgesellschaften. Herr Dempsey hatte leitende Positionen bei Barclays Global Investors/BlackRock inne, u. a. Head of Product Governance, Head of Product Strategy iShares EMEA und Head of Product Structuring EMEA. Zuvor war er auch als Group Legal Counsel bei Eagle Star Life Ireland (jetzt Zurich Financial Services), als Head of Legal bei ETF Securities und als leitender Rechtsanwalt bei Pioneer Amundi tätig.

Herr Dempsey hat einen BA(Hons) sowie einen LLB(Hons) vom University College Galway und ein Diplom im Finanzdienstleistungsrecht vom University College Dublin. 1996 wurde er in das irische Anwaltsverzeichnis (Roll of Solicitors) und 2005 in die England and Wales Law Society aufgenommen. Er war im rechtlichen und regulatorischen Ausschuss (Legal and Regulatory Committee) von Irish Funds und der ETF Working Group bei der European Fund Asset Management Association tätig.

- Howie Li (Kanadier, Wohnsitz im Vereinigten Königreich) – nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied – am 23. März 2020 in den Verwaltungsrat berufen

Herr Li hat über 16 Jahre Erfahrung in der Vermögensverwaltungsbranche und ist leitender Angestellter der Legal & General Investment Management Limited. Herr Li kam zur Legal & General Investment Management Limited nach der erfolgreichen Übernahme von ETF Securities im Jahr 2018. Herr Li ist als Global Head of Index and ETF bei der Legal & General Investment Management Limited tätig und verantwortlich für die Leitung der Entwicklung und des Wachstums des ETF-Geschäfts. Bevor er zur Legal & General Investment Management Limited wechselte, hatte Herr Li mehrere führende Positionen bei ETF Securities inne, u. a. Head of Legal, Co-Head und CEO. Herr Li begann seine Karriere bei Simmons & Simmons LLP als Anwalt für Finanzdienstleistungsrecht.

Herr Li hat einen LLB von der University of Leeds und ist in England und Wales als Jurist qualifiziert. Er wurde 2007 in die England and Wales Law Society aufgenommen.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

B. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

1. Zusammensetzung des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

- Patrizia Libotte (Italienerin, Wohnsitz in Irland) – nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied – am 23. Juni 2020 in den Verwaltungsrat berufen

Frau Libotte hält die Position des Head of Investments bei der LGIM Managers (Europe) Limited. Frau Libotte wechselte im Mai 2019 zur Legal & General Investment Management Limited und war zuvor für Aviva Ireland tätig, wo sie den Titel Director of Multi Asset Funds bekleidete und für die Entwicklung, Umsetzung und Verwaltung des Investmentprogramms für zwei Reihen von Target-Risk-Multi-Asset-Fonds verantwortlich war. Davor war Frau Libotte Head of Multi Asset and Global Strategy bei dem in Dublin ansässigen unabhängigen Boutique-Vermögensverwalter Covestone Asset Management und federführend für Anlageentscheidungen in Bezug auf eine breite Palette an Vermögenswerten, u. a. Aktien, Anleihen, Rohstoffe und alternative Anlagen. Frau Libotte begann ihre Karriere bei Pioneer Investment in Dublin, wo sie getrennte Festzinsmandate für institutionelle Kunden verwaltete. Nachdem sie fast zwanzig Jahre in verschiedenen Funktionen in der Anlageverwaltungsbranche tätig war – als Fondsmanager, Stratege, Multi-Asset-Allokator, Dachfonds-Portfoliomanager – verfügt Frau Libotte über Kenntnisse aus erster Hand und ein starkes Verständnis der Finanzmärkte, der verschiedenen Anlagentypen und aufsichtsrechtlichen Rahmen in Europa. Frau Libotte hat einen Bachelor of Commerce International mit Deutsch und hat zwei Master-Abschlüsse in Business Studies: einer in International Business und einer in Quantitative Finance. Frau Libotte ist zweisprachig in Italienisch und Englisch.

- David Fagan (irische Staatsangehörigkeit, Wohnsitz in Irland) – unabhängiges nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied, Vorsitzender des Prüfungsausschusses – am 16. Juli 2020 in den Verwaltungsrat berufen

Herr Fagan begann seine berufliche Laufbahn bei Irlands größter Versicherungsgesellschaft Irish Life, wo er verschiedene Funktionen im Rechnungswesen, in der Finanzverwaltung und im Marketing-Management in Irland und im Vereinigten Königreich bekleidete. 1998 wurde Herr Fagan zum Chief Executive von Irish Life International berufen, einer grenzüberschreitend tätigen Lebensversicherungs- und Investmentsparte der Irish Life Group. 2007 wechselte Herr Fagan als Chief Executive von Legal & General International zu Legal & General. Diesen Geschäftsbereich sollte er im Auftrag der Legal & General Group etablieren und ausbauen. In diesem Zeitraum war Herr Fagan auch für Suffolk Life zuständig, eine konzerninterne Self-Invested-Pension-Sparte. 2013 wurde Herr Fagan zum Managing Director - Retail Savings Distribution der Legal & General Group ernannt. In dieser Funktion verantwortete er verschiedene der größten unabhängigen und gebundenen Vertriebsbeziehungen des gesamten britischen Markts. Zu seinem Aufgabenbereich zählte auch die Mitgliedschaft im Verwaltungsrat von Cofunds, der größten Investmentplattform des Vereinigten Königreichs. Herr Fagan ist Fellow der Chartered Association of Certified Accountants (FCCA) und gehörte im Lauf der Jahre etlichen renommierten Beratungsgremien der Branche und der Regierung an.

- Donard McClean (irische Staatsangehörigkeit, Wohnsitz in Irland) – unabhängiges nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied, Mitglied des Prüfungsausschusses – am 15. März 2021 in den Verwaltungsrat berufen

Herr McClean ist seit 1989 in der Finanzdienstleistungsbranche tätig und fungiert als unabhängiges Verwaltungsratsmitglied für Fonds und Fondsverwaltungsgesellschaften. Von 2006 bis 2018 war er CEO und Ireland Location Head bei MUFG Investor Services (vormals UBS). In diesem Zeitraum organisierte und managte er sämtliche Aspekte des UBS- und MUFG-Fondsgeschäfts in Irland und gehörte globalen Compliance-, Operations- und Kundenserviceausschüssen an. Er war Verwaltungsratsmitglied von Fondsdienstleistern in Irland (zugelassen gemäß IIA und MiFID), auf der Isle of Man und Jersey. Herr McClean ist nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied mehrerer OGAW- und Nicht-OGAW-Umbrella-Fonds sowie einer Fondsverwaltungsgesellschaft. Er verfügt über Fachkenntnisse aus der irischen und internationalen Fondsindustrie, insbesondere im Zusammenhang mit Risiken, Compliance und Governance in allen Fragen zu Fondsverwaltung, Verwahrung, Verwaltungsgesellschaft, Vermögensverwaltung und damit zusammenhängenden Bankdienstleistungen. Vor seiner Tätigkeit bei UBS war Donard McClean neun Jahre lang bei Fortis Prime Fund Solutions beschäftigt. Dort war er Director of Operations mit Verantwortung für Verwaltung, Verwahrung und Back-Office-Bankbetrieb. Vor seinem Wechsel zu Fortis hatte er seine Laufbahn als Wirtschaftsprüfer bei Coopers and Lybrand Channel Islands begonnen. Er ist Fellow der Association of Chartered Certified Accountants, hat einen BA der UCD in Wirtschafts- und Politikwissenschaft sowie ein Post Graduate Diploma in Business Studies von der Michael Smurfit School of Business UCD.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

B. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

2. Unterstützung für Verwaltungsratsmitglieder

Die Verwaltungsratsmitglieder haben bei Bedarf ferner Zugang zu der Beratung und den Dienstleistungen des Gesellschaftssekretärs, externen juristischen Beratern und den Ressourcen des Anlageverwalters und der globalen Vertriebsstelle. Wenn nötig, können der Verwaltungsrat und einzelne Verwaltungsratsmitglieder, um die Erfüllung ihrer Pflichten zu erleichtern, auf Kosten der Verwaltungsgesellschaft professionelle Beratung in Anspruch nehmen.

3. Versicherung

Die Gesellschaft hat das gesamte Geschäftsjahr über eine angemessene Haftpflichtversicherung für ihre Verwaltungsratsmitglieder und leitenden Angestellten unterhalten.

4. Bestellung

Der Verwaltungsrat ist verantwortlich für die Überprüfung der Größe, Struktur und Zusammensetzung des Verwaltungsrats und für die Erwägung von Änderungen oder Neubestellungen. Der Verwaltungsrat kann einen externen Personalberater mit der Suche nach potenziellen Kandidaten beauftragen. Bislang ist der Verwaltungsrat jedoch selbst in der Lage gewesen, die geeignetsten Kandidaten für die Aufnahme im Verwaltungsrat durch seinen eigenen Auswahlprozess zu ermitteln, und hat deshalb noch keinen Bedarf für die Beauftragung eines externen Personalberaters gesehen. Im Rahmen des mit der generellen Überprüfung potenzieller Kandidaten verbundenen Due-Diligence-Verfahrens holt der Verwaltungsrat Empfehlungen und Referenzen von externen Dienstleistern und Beratern der Gesellschaft ein, bevor eine Bestellung erfolgt. Bestellungen in den Verwaltungsrat unterliegen ferner der Genehmigung der Zentralbank.

Der Verwaltungsrat hält Vielfalt unter seinen Mitgliedern für vorteilhaft und versucht deshalb sicherzustellen, dass die Größe, Struktur und Zusammensetzung des Verwaltungsrats, einschließlich Fähigkeiten, Wissen, Erfahrung und Diversität (auch in Bezug auf Geschlechter) für die effektive Leitung und Kontrolle der Gesellschaft ausreichend sind.

5. Ausschüsse des Verwaltungsrats

Prüfungsausschuss

Der Prüfungsausschuss setzt sich aus zwei unabhängigen, nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern zusammen: Donard McClean und David Fagan, der den Vorsitz innehat. Weitere Informationen über den Aufgabenumfang des Prüfungsausschusses sind im Abschnitt „Prüfungsausschuss“ im nachstehenden Abschnitt D enthalten.

Der Verwaltungsrat hat nicht direkt weitere Ausschüsse eingerichtet, an die Aufgaben delegiert werden.

6. Vergütung von Verwaltungsratsmitgliedern

Die Gesellschaft hat keinen Vergütungsausschuss gebildet, da die Gesellschaft eine offene Investmentgesellschaft ohne Beschäftigte oder geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder ist. Kein Verwaltungsratsmitglied hatte oder hat Anspruch auf Pensionen, und die Gesellschaft hat keinem Verwaltungsratsmitglied Aktienoptionen oder langfristige Leistungsanreize gewährt. Kein Element der Vergütung von Verwaltungsratsmitgliedern ist leistungsabhängig.

Die nicht unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder (die bei der L&G Unternehmensgruppe angestellt sind) haben keinen Anspruch auf Erhalt eines Verwaltungsratshonorars. Nur den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern wurden Honorare gezahlt. Diese Honorare werden vom Verwaltungsrat festgelegt. Infolgedessen wurde kein Bericht über Vergütungen erstellt.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

B. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

6. Vergütung von Verwaltungsratsmitgliedern (Fortsetzung)

Der Verwaltungsrat ist der Meinung, dass die Höhe der Vergütung für die unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder dem Zeitaufwand und der Verantwortung ihrer Funktionen angemessen ist. Der Verwaltungsrat prüft periodisch die Höhe der Vergütung für die unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder.

Die Verwaltungsratsmitglieder unterliegen der ständigen Verpflichtung dafür Sorge zu tragen, dass sie über ausreichend Zeit verfügen, um ihren Aufgaben nachzukommen. Die Details der sonstigen Ernennungen und Verpflichtungen jedes Verwaltungsratsmitglieds werden dem Verwaltungsrat zur Prüfung vorgelegt.

7. Bericht über Mitgliedschaft und Diversität im Verwaltungsrat

Der Verwaltungsrat erkennt die Bedeutung an, die der Diversität für operative Verbesserungen zukommt. Im Auswahlverfahren ist der Verwaltungsrat verpflichtet, auf Diversität bezüglich Alter, Geschlecht, Ausbildung und beruflichem Hintergrund zu achten. Zur Bestellung werden Kandidaten auf der Grundlage dieser Attribute ausgewählt. Der Verwaltungsrat stellt sicher, dass sämtliche Auswahlentscheidungen auf Leistung basieren und die Einstellung gerecht und nicht diskriminierend erfolgt. Nach Überzeugung des Verwaltungsrats ist eine Vielfalt an Erfahrungen und Ansätzen, einschließlich Ausbildung und beruflichem Hintergrund, Geschlecht und Alter, unter den Verwaltungsratsmitgliedern von großem Wert bei der Berücksichtigung der allgemeinen Ausgewogenheit bei Entscheidungen über die Ernennung neuer Verwaltungsratsmitglieder. Für den Verwaltungsrat hat Priorität, dass er weiterhin führungsstark ist und über die einschlägigen Kompetenzen verfügt, um die Geschäftsstrategie umzusetzen. Der Verwaltungsrat hat sich für Geschlechterdiversität keine konkreten Ziele gesetzt, erkennt jedoch ihre Bedeutung an.

C. Risikomanagement und interne Kontrolle

1. Obliegenheiten des und Aufsicht durch den Verwaltungsrat der Gesellschaft

Der Verwaltungsrat ist letztinstanzlich verantwortlich für die internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme der Gesellschaft und für die Prüfung ihrer Effektivität. Er hat sicherzustellen, dass die Finanzdaten, die veröffentlicht oder innerhalb der Gesellschaft verwendet werden, verlässlich sind, und hat regelmäßig zu überwachen, dass die für den Betrieb der Gesellschaft geltenden Bestimmungen erfüllt werden.

Delegierung an die Verwaltungsgesellschaft

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat der Verwaltungsgesellschaft alle Befugnisse, Pflichten und Entscheidungsfreiheiten anvertraut und übertragen, die in Bezug auf die Verwaltung der Gesellschaft auszuüben sind, insbesondere die Verwaltungs-, Anlageverwaltungs-, Verkaufsförderungs- und Vertriebsfunktionen der Gesellschaft, vorbehaltlich der Gesamtüberwachung und -kontrolle durch den Verwaltungsrat der Gesellschaft. Da das Geschäft der Gesellschaft nach einem „Bevollmächtigtenmodell“ betrieben wird, wie es für offene irische Organismen für gemeinsame Anlagen üblich ist, hat die Verwaltungsgesellschaft selbst einen großen Teil ihrer Funktionen auf ausgewählte Konzerngesellschaften der L&G-Gruppe und unternehmensfremde Dienstleister übertragen (zusammen die „Bevollmächtigten“).

Anlageverwalter

Am 1. November 2021 wurde Legal & General Investment Management Limited als Anlageverwalter für die einzelnen Aktien- und Rohstofffonds bestellt, womit diese Gesellschaft für die Anlageverwaltung der Vermögenswerte der Aktien- und der Rohstofffonds verantwortlich ist. Der Anlageverwalter unterliegt stets der Überwachung und Leitung der Verwaltungsgesellschaft.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

C. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

1. Obliegenheiten des und Aufsicht durch den Verwaltungsrat der Gesellschaft (Fortsetzung)

Anlageverwalter (Fortsetzung)

Der Anlageverwalter übt seine Tätigkeit gemäß den vom Verwaltungsrat der Gesellschaft festgelegten Anlagezielen und -strategien und wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft und in den fondsspezifischen Nachträgen dazu beschrieben aus. Der Anlageverwalter ist unmittelbar verantwortlich für die Entscheidungen über das Tagesgeschäft der Fonds und dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft gegenüber rechenschaftspflichtig für die Anlageperformance der Fonds. Die Verwaltungsgesellschaft hat auch das tägliche Management der mit den Anlagen der Fonds verbundenen Risiken auf den Anlageverwalter übertragen. Der Anlageverwalter gewährleistet, dass es einen angemessenen Risikomanagementprozess für die Gesellschaft und ihre Fonds gibt, und dass dessen Funktionsweise hinreichend ist. Der Anlageverwalter kann mit der Zustimmung der Verwaltungsgesellschaft und vorbehaltlich der Genehmigung seitens der Zentralbank, falls erforderlich, Aufgaben an Unteranlageverwalter/Berater oder andere Bevollmächtigte delegieren. Einzelheiten zu diesen ggf. bestellten Unternehmen werden Anteilhabern auf Anfrage zur Verfügung gestellt und in den Jahres- und Halbjahresberichten der Gesellschaft veröffentlicht. Der Anlageverwalter hat seinen Sitz im Vereinigten Königreich, ist von der britischen Financial Conduct Authority (die „FCA“) zugelassen und untersteht deren Aufsicht und gehört zur Unternehmensgruppe von L&G.

2. Der Überwachungsrahmen der Verwaltungsgesellschaft für die Risikokontrolle

Unteranlageverwalter

Globale Vertriebsstelle

Die Verwaltungsgesellschaft hat den Vertrieb, das Marketing, das Rechts- und Compliance-Management, die Produktentwicklung und andere Support-Dienste an die Legal & General Investment Management Limited delegiert.

Die globale Vertriebsstelle hat ihren Sitz im Vereinigten Königreich, ist von der FCA zugelassen, untersteht deren Aufsicht und gehört zur L&G Group.

Weitere Vertriebsstellen finden Sie in den Abschnitten „Verwaltungsratsmitglieder“ und „Sonstige Informationen“.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

C. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

2. Der Überwachungsrahmen der Verwaltungsgesellschaft für die Risikokontrolle (Fortsetzung)

Verwalter und Registerstelle

Die Verwaltungsgesellschaft hat die BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company als Verwalter, Transfer- und Registerstelle der Gesellschaft bestellt und ihr die Verantwortung für die tägliche Verwaltung der Gesellschaft übertragen. Hierzu gehört neben Transferstellendiensten auch die Berechnung des Nettoinventarwertes für die einzelnen Fonds und die Aufstellung der Abschlüsse der Gesellschaft unabhängig von der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle. Der Verwalter kümmert sich insbesondere um Zeichnungs- und Rücknahmeanträge von Anteilhabern und holt Bewertungen für alle Anlagen der Fonds gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft und speziellen, mit dem Anlageverwalter vereinbarten Bewertungsmatrizen ein.

Der Verwalter ist eine Designated Activity Company, die am 31. Mai 1994 in Irland gegründet wurde und deren Tätigkeit Dienstleistungen in den Bereichen Fondsverwaltung, Rechnungswesen, Registrierung, Transferdienste und damit zusammenhängende Dienstleistungen für Organismen für gemeinsame Anlagen und Investmentfonds sind.

Der Verwalter ist von der Zentralbank gemäß dem Investment Intermediaries Act von 1995 zugelassen.

Verwahrstelle

Anders als die vorstehend beschriebenen Bevollmächtigten, die alle von der Verwaltungsgesellschaft bestellt wurden, hat die Gesellschaft The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch direkt als Verwahrstelle für ihre Vermögenswerte bestellt mit der doppelten Verantwortung, die Art und Weise zu überwachen, in der die Gesellschaft verwaltet wird, und die Vermögenswerte der Gesellschaft gemäß den OGAW-Vorschriften sicher zu verwahren. Die Hauptgeschäftstätigkeit der Verwahrstelle besteht in ihrer Aufgabe als Verwahrstelle und Treuhänder für die Vermögenswerte von Organismen für gemeinsame Anlagen.

Ungeachtet der Ernennung der Verwahrstelle durch die Gesellschaft fällt die Überwachung und Überprüfung der Tätigkeit der Verwahrstelle in den Überwachungsrahmen der Verwaltungsgesellschaft.

Verwaltungsgesellschaft

Der vorstehenden Delegation an die Verwaltungsgesellschaft zufolge wird die Aufgabe der Überwachung und Überprüfung der internen Kontrollen und Risikomanagementsysteme den Bevollmächtigten (einschließlich der Verwahrstelle) ausgenommen im Kontext der Finanzberichterstattung vom „Risikoüberwachungsausschuss“ ausgeübt, einem Ausschuss, der sich aus dem designierten Verantwortlichen für das Fondsrisikomanagement und das betriebliche Risikomanagement (zusammen „Risikomanagement“) und verschiedenen Mitarbeitern der L&G Unternehmensgruppe, die Aufgaben der Risikokontrolle und Compliance-Kontrolle in Bezug auf das Geschäft der Gesellschaft ausüben (d.h. es handelt sich nicht um einen Ausschuss des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft).

Als OGAW-Verwaltungsgesellschaft wurde von der Verwaltungsgesellschaft ein stabiler Rahmen für die interne Kontrolle und das Risikomanagement in Bezug auf das Geschäft der Gesellschaft gemäß den OGAW-Vorschriften eingerichtet. Dieser Rahmen ist nicht auf das Ausschalten sondern vielmehr auf die Steuerung des Risikos ausgelegt, dass die Gesellschaft ihre Unternehmensziele nicht erreicht. Folglich kann er nur eine angemessene, aber keine absolute Absicherung gegen wesentliche Falschangaben oder Verluste bieten und stützt sich auf die operative Kontrolle und die Kontrolle des Risikomanagements, die von den Bevollmächtigten eingerichtet wurden.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

C. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

2. Der Überwachungsrahmen der Verwaltungsgesellschaft für die Risikokontrolle (Fortsetzung)

Berichterstattung durch die Bevollmächtigten

Die Verwaltungsgesellschaft hat dem Verwaltungsrat der Gesellschaft gegenüber ferner bestätigt, dass sie sich davon überzeugt hat, dass sie die notwendigen Ressourcen und Fachkenntnisse zur effektiven Kontrolle der Aktivitäten der Bevollmächtigten hat und verschiedene Sicherheitsvorkehrungen und Kontrollen zur Sicherstellung eingeführt hat, dass diese Aktivitäten genau überwacht werden, insbesondere in Bezug auf die mit diesen Vereinbarungen verbundenen potenziellen Risiken. Des Weiteren hat die Verwaltungsgesellschaft gegenüber dem Verwaltungsrat der Gesellschaft bestätigt, dass sie sich davon überzeugt hat, dass die Verteilung von Aufgaben auf Verwaltungsratsebene sich nicht auf die Fähigkeit einer dieser Personen auswirkt, ihre jeweiligen Pflichten mit der erforderlichen Fachkenntnis und Sorgfalt auszuüben. Entsprechend ist der Verwaltungsrat in Bezug auf die Effektivität der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme zufrieden, über die von der Verwaltungsgesellschaft für das Berichtsjahr und bis zum Genehmigungsdatum des Jahresabschlusses berichtet wurde, und ist sich keiner wesentlichen Schwachstelle bewusst, die während dieser Überprüfung aufgetreten wäre.

Funktionen, die dem Verwaltungsrat der Gesellschaft vorbehalten bleiben

Ungeachtet der Bestellung der Verwaltungsgesellschaft behält sich der Verwaltungsrat der Gesellschaft die funktionalen Aspekte der Überwachung und Überprüfung der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme der Bevollmächtigten im Finanzberichterstattungskontext vor. Zu diesem Zweck wurde eigens ein Prüfungsausschuss eingerichtet, der sich aus zwei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft zusammensetzt. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Abschnitt 2 „Der Überwachungsrahmen der Gesellschaft für die Risikokontrolle im Hinblick auf die Finanzberichterstattung“.

Während der Verwaltungsrat der Gesellschaft auf die Verwaltungsgesellschaft generell alle Befugnisse, Pflichten und Entscheidungsfreiheiten übertragen hat, die in Bezug auf die Verwaltung des Geschäfts auszuüben sind, behält er sich Entscheidungen in folgenden Zusammenhängen vor:

- die Auflegung und Auflösung von Fonds und deren Anteilklassen;
- die Festlegung der Anlageziele und der Anlagestrategien der Fonds;
- die Festlegung der „Gesamtkostenquote“ für die einzelnen Fonds und ihre Anteilklassen;
- grenzüberschreitende Registrierungen der Fonds;
- Börsennotierungen
- die Bestellung des Gesellschaftssekretärs, der Verwahrstelle und des Abschlussprüfers;
- der Abschluss und die Kündigung wesentlicher Verträge und
- die Genehmigung der Verkaufsprospekte, Rundschreiben an die Anteilinhaber und anderer rechtlich relevanter Dokumente.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist letztendlich auch für die Überwachung und Beurteilung der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme des Geschäfts der Gesellschaft verantwortlich.

Diesbezüglich vergewissert sich der Verwaltungsrat der Gesellschaft kontinuierlich, dass er eine wirksame Aufsicht über die funktionale Rolle der Verwaltungsgesellschaft hinsichtlich der Überwachung und Überprüfung der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme der verschiedenen Bevollmächtigten durch die Verwaltungsgesellschaft ausübt. Der Verwaltungsrat der Gesellschaft behält es sich vor, der Verwaltungsgesellschaft bei Bedarf selbst Richtlinien und/oder Anweisungen im Zusammenhang mit der Ausübung des Geschäfts der Gesellschaft vorzugeben bzw. zu erteilen.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

C. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

2. Der Überwachungsrahmen der Verwaltungsgesellschaft für die Risikokontrolle (Fortsetzung)

Funktionen, die dem Verwaltungsrat der Gesellschaft vorbehalten bleiben (Fortsetzung)

Gemäß vorstehenden Ausführungen vergewissert sich der Verwaltungsrat der Gesellschaft, dass er für das Berichtsjahr die Wirksamkeit der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme des Geschäfts der Gesellschaft wirksam überprüft hat, sowohl im Hinblick auf an die Verwaltungsgesellschaft delegierte Angelegenheiten als auch bezüglich der Finanzberichterstattung, die er es sich selbst vorbehalten hat, und dass ihm keine erheblichen Schwachstellen bekannt sind, die sich um Zuge der Überprüfung ergeben haben. Die Systeme hatten das gesamte Berichtsjahr über und bis zum Datum der Genehmigung des Jahresberichts Bestand.

3. Der Überwachungsrahmen der Gesellschaft für die Risikokontrolle im Hinblick auf die Finanzberichterstattung

Wie im obigen Abschnitt C.1 beschrieben, hat sich der Verwaltungsrat der Gesellschaft die Aufgabe der Überwachung und Beurteilung interner Kontrollen und Risiken im Zusammenhang mit der Finanzberichterstattung vorbehalten und diese an den Prüfungsausschuss delegiert. Die Gesellschaft hat Verfahren zur Sicherstellung eingeführt, dass alle maßgeblichen Geschäftsbücher und Aufzeichnungen ordnungsgemäß geführt werden und jederzeit verfügbar sind, einschließlich der Erstellung von Jahres- und Halbjahresabschlüssen.

Die Gesellschaft hat Ernst & Young als Abschlussprüfer der Gesellschaft für das zu prüfende Geschäftsjahr bestellt.

Der Verwalter ist von der Verwaltungsgesellschaft zur Führung der Geschäftsbücher und Aufzeichnungen der Gesellschaft unabhängig vom Anlageverwalter und der Verwahrstelle bestellt worden. Der Verwalter ist von der Zentralbank zugelassen, untersteht deren Aufsicht und muss die von der Zentralbank erlassenen Vorschriften befolgen. Die Jahres- und Halbjahresabschlüsse der Gesellschaft müssen vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigt und bei der Zentralbank, der Eidgenössische Finanzmarktaufsicht („FINMA“) und allen Aufsichtsbehörden derjenigen EWR-Mitgliedstaaten eingereicht werden, in denen das Verfahren für den Erhalt eines Passes zum länderübergreifenden Vertrieb von OGAW abgeschlossen wurde.

Der Jahresabschluss wurde gemäß den EU-IFRS, dem Companies Act 2014, den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften und der OGAW-Vorschriften der Zentralbank aufgestellt. Der Abschluss im Jahresbericht muss geprüft sein. Der Bericht der Abschlussprüfer an die Anteilhaber, einschließlich etwaiger Einschränkungen, wird im Jahresbericht der Gesellschaft vollständig wiedergegeben.

Prüfungsausschuss

Gemäß Section 167 des Companies Act von 2014 richtete die Gesellschaft im März 2014 einen Prüfungsausschuss ein, der sich aus den zwei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern zusammensetzt. Aktuell setzt sich der Prüfungsausschuss aus Donard McClean und Dave Fagan zusammen, der zum Vorsitzenden des Prüfungsausschusses ernannt wurde.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

C. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

3. Der Überwachungsrahmen der Gesellschaft für die Risikokontrolle im Hinblick auf die Finanzberichterstattung (Fortsetzung)

Prüfungsausschuss (Fortsetzung)

Das Hauptziel des Prüfungsausschusses besteht darin, den Verwaltungsrat der Gesellschaft bei dessen Überwachungsaufgaben in Bezug auf finanzielle Kontrollen und Berichterstattung zu unterstützen, damit gewährleistet wird, dass die Interessen der Anteilhaber der Gesellschaft richtig geschützt werden. Die Hauptaufgaben des Prüfungsausschusses sind:

- Überwachung der Integrität der Rechnungsabschlüsse der Gesellschaft sowie sämtlicher formeller Bekanntgaben bezüglich der finanziellen Performance der Gesellschaft und Überprüfung der wesentlichen in der Finanzberichterstattung enthaltenen Beurteilungen und Bericht an den Verwaltungsrat darüber, ob der Abschluss in seiner Gesamtheit einen fairen, ausgewogenen und verständlichen Überblick über die Ergebnisentwicklung, das Geschäftsmodell und die Strategie der Gesellschaft vermittelt;
- Prüfung und Beurteilung der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme der Gesellschaft im Zusammenhang mit der Finanzberichterstattung, einschließlich der Verfahren der Gesellschaft zur Vermeidung und Aufdeckung von Betrug;
- Überwachung und Prüfung der Wirksamkeit des Vertrauens der Gesellschaft auf die Innenrevisionsfunktionen der Bevollmächtigten;
- Empfehlungen an den Verwaltungsrat im Zusammenhang mit der Bestellung, Wiederbestellung und Abberufung der Abschlussprüfer und der Vergütung und Konditionen für die Beauftragung der Abschlussprüfer;
- Überprüfung und Überwachung der Unabhängigkeit und Objektivität der Abschlussprüfer sowie der Effektivität des Prüfungsprozesses unter Berücksichtigung der maßgeblichen rechtlichen und regulatorischen Anforderungen;
- Besprechung mit den Abschlussprüfern zu deren allgemeinem Ansatz sowie Art und Umfang ihrer Prüfung und Berichtspflichten sowie Sicherstellung, dass es keine offenen Fragen oder Bedenken gibt;
- Entwicklung und Implementierung von Richtlinien zur Beauftragung der Abschlussprüfer mit prüfungsfremden Dienstleistungen unter Berücksichtigung der maßgeblichen ethischen Richtlinien für die Erbringung von prüfungsfremden Dienstleistungen durch die externe Wirtschaftsprüfungsgesellschaft und
- Berichterstattung an den Verwaltungsrat darüber, wie er seine Aufgaben wahrgenommen hat, Benennung aller Angelegenheiten, für die nach Erachten des Ausschusses Handlungs- oder Verbesserungsbedarf besteht, mit Empfehlung der entsprechenden Schritte.

Der Prüfungsausschuss hat eine schriftliche Geschäftsordnung, die zur Sicherstellung ihrer Aktualität und der Angemessenheit der Aufgaben und Pflichten des Prüfungsausschusses jährlich überprüft wird. Diese Geschäftsordnung kann auf der Jahreshauptversammlung der Gesellschaft (die „JHV“) und am eingetragenen Sitz der Gesellschaft eingesehen werden.

Verwaltungsratsmitglieder, die nicht Mitglieder des Prüfungsausschusses sind, können auf Einladung des Vorsitzenden vom Prüfungsausschuss an Sitzungen des Prüfungsausschusses teilnehmen. Andere Personen, die keine Mitglieder des Prüfungsausschusses sind, können vom Vorsitzenden des Prüfungsausschusses zeitweilig zur Teilnahme an Sitzungen des Prüfungsausschusses eingeladen werden. Dazu können insbesondere der Chief Financial Officer (CFO) für LGIMH, der Innenrevisor für LGIMH, der Compliance-Beauftragte für die Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter und die globale Vertriebsstelle und Vertreter der Abschlussprüfer gehören.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

C. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

3. Der Überwachungsrahmen der Gesellschaft für die Risikokontrolle im Hinblick auf die Finanzberichterstattung (Fortsetzung)

Prüfungsausschuss (Fortsetzung)

Sitzungen des Prüfungsausschusses sind mindestens drei Mal jährlich abzuhalten und fallen gegebenenfalls mit wichtigen Terminen im Berichterstattungszyklus der Gesellschaft zusammen, um den Plan, Zeitplan und Umfang der Prüfung zusammen mit dem externen Abschlussprüfer festzulegen, zur Überprüfung der internen Finanzkontrollen, des Entwurfs der Jahres- und Halbjahresabschlüsse und der Bilanzierungsgrundsätze der Gesellschaft. Der Prüfungsausschuss führt eine Überprüfung des Inhalts des Jahresberichts in der Absicht durch, den Verwaltungsrat zu beraten, ob der Jahresbericht ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes und ausgewogenes Bild vermittelt und Anteilinhabern die Informationen liefert, die notwendig sind, um die Ergebnisentwicklung und Geschäftsstrategie der Gesellschaft bewerten zu können.

Der Prüfungsausschuss überprüft mindestens einmal jährlich seine eigene Leistung, die Zusammensetzung der Mitglieder und die Geschäftsordnung zwecks Sicherstellung, dass er mit maximaler Effizienz arbeitet, und schlägt von ihm für erforderlich erachtete Änderungen dem Verwaltungsrat zur Genehmigung vor.

Die Mitgliedschaft des Prüfungsausschusses ist vom Verwaltungsrat jährlich zu überprüfen.

4. Austritt des Vereinigten Königreichs aus der EU

Mit Ablauf der Übergangsfrist haben EU-Fonds alle mit dem Europäischen Pass verbundenen Rechte auf grenzüberschreitende Tätigkeit im Vereinigten Königreich verloren. Mit der Einführung einer vorübergehenden Genehmigung (Temporary Permissions Regime) durch das Vereinigte Königreich können aber alle entsprechend registrierten Fonds weiter im Vereinigten Königreich vertrieben und von dort ansässigen Anlegern erworben werden. Die britische Regierung hat eigene Gesetze auf den Weg gebracht, um das Verfahren dafür zu straffen, dass ausländische Investmentfonds (auch solche aus der EU) nach dem Brexit im Vereinigten Königreich vertrieben werden dürfen.

Zum Stichtag dieses Abschlusses werden die Fonds nach wie vor von der FCA anerkannt und können an britische Anleger vermarktet werden.

Überwachungs- und Überprüfungstätigkeiten

Es wurden spezielle Verfahren zur Überwachung der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme und zur Erfassung und Auswertung etwaiger Mängel oder Schwachpunkte konzipiert. Wird ein Einzelfall vom Verwaltungsrat als bedeutsam eingestuft, so gibt es Verfahren, um sicherzustellen, dass die nötigen Maßnahmen getroffen werden, um die Mängel zu beheben.

Im vorliegenden Berichtsjahr berichtete die Verwahrstelle quartalsmäßig an den Verwaltungsrat.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält einen jährlichen Service Organisational Control Report über die internen Kontrollen des administrativen und des Transferstellenbetriebs der Gesellschaft, und der Verwalter berichtet jährlich direkt an den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft.

D. Anteilinhaber-Beziehungen

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft, und die Anteilinhaber der Fonds investieren in die Fondspalette, um sich in den jeweiligen von den Fonds nachgebildeten Finanzindizes zu engagieren. Alle maßgeblichen Informationen in Bezug auf den von den einzelnen Fonds nachgebildeten Index und die Methode, mit der jeder Fonds seinen Index nachbilden will, sind im Verkaufsprospekt der Gesellschaft, fondsspezifischen Nachträgen und in den wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) (zusammen die „Angebotsunterlagen“) enthalten.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

D. Anteilinhaber-Beziehungen (Fortsetzung)

Die Gesellschaft kommuniziert mit den Anteilhabern durch die Jahres- und Halbjahresberichte, welche die Anteilhaber umfassend über die Aktivitäten der Gesellschaft und ihre Ergebnisse in Kenntnis setzen sollen. Die Gesellschaft veröffentlicht die Jahres- und Halbjahresberichte zusammen mit Exemplaren des Verkaufsprospekts, Factsheets, Handelsterminplänen für den Primärmarkt, Informationsschriften und Rundschreiben an Anteilhaber auf einer von der globalen Vertriebsstelle unterhaltenen Website (<http://www.lgim.com>). Die tägliche Berechnung des Nettoinventarwerts für die einzelnen Fonds wird ebenfalls auf der Website der Gesellschaft und an den verschiedenen Börsen, an denen die Anteile der Fonds jeweils notiert werden, veröffentlicht.

Wie oben erwähnt, unterhält die globale Vertriebsstelle eine Website (<https://www.lgim.com>), auf der Anlegern eine Vielzahl zusätzlicher Informationen zur Verfügung stehen (gemäß Angabe in den Angebotsunterlagen) zusammen mit einer E-Mail-Adresse (fundsales@lgim.com) und Telefonnummer +44 (0)20 3124 3000) für Anleger, die zusätzliche Informationen wünschen. Angesichts des Vorstehenden ist der Verwaltungsrat der Meinung, dass er angemessene Kommunikationswege für Anteilhaber unterhält, und er hält es nicht für erforderlich, dass alle Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft an der Jahreshauptversammlung („JHV“) der Gesellschaft teilnehmen.

Über wesentliche betriebliche und strategische Angelegenheiten der Gesellschaft wird durch den Verwaltungsrat entschieden. Ungeachtet des Vorstehenden nominiert der Verwaltungsrat eines der unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder, an jeder Hauptversammlung der Gesellschaft teilzunehmen und den Vorsitz zu übernehmen. Wenn Anteilhaber auf einer dieser Hauptversammlungen Angelegenheiten in Bezug auf die Unternehmensführung und Verwaltung der Gesellschaft erörtern möchten, stellt sich das maßgebliche Verwaltungsratsmitglied soweit es die Zeit erlaubt hierfür zur Verfügung. Alternativ können Anteilhaber Anfragen über die oben genannte E-Mail-Adresse einreichen.

Die Verwaltungsgesellschaft hat die globale Vertriebsstelle bestellt, die mit dem aktiven Management der Beziehungen zwischen der Gesellschaft und Anlegern betraut ist. Die globale Vertriebsstelle liefert dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft vierteljährliche Aktualisierungen, welche die Hauptinformationsquelle für die Verwaltungsratsmitglieder darstellen, um einen Einblick in die Ansichten der wichtigsten Anleger in den Fonds zu erhalten. Ein leitender Vertreter der globalen Vertriebsstelle nimmt an jeder vierteljährlichen Sitzung des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft teil, um in Bezug auf aktuelle Anlegerbeziehungen zu berichten.

1. Anteilhaberversammlungen

Die Einberufung und Durchführung von Versammlungen der Anteilhaber sind in der Satzung und im Companies Act 2014 geregelt. Obwohl der Verwaltungsrat eine außerordentliche Hauptversammlung („AHV“) der Gesellschaft jederzeit einberufen kann, muss der Verwaltungsrat eine JHV der Gesellschaft in jedem Kalenderjahr einberufen, und zwischen dem Termin einer JHV und der nächsten dürfen nicht mehr als fünfzehn Monate vergehen.

Allen Anteilhabern wird die Teilnahme an der JHV zur Erörterung der Tagesordnungspunkte und Ausübung ihrer Stimmrechte empfohlen.

Sämtliche Hauptversammlungen der Gesellschaft werden in Irland abgehalten. Gemäß der Satzung der Gesellschaft werden eine JHV und eine AHV, die für die Verabschiedung eines Sonderbeschlusses der Gesellschaft einberufen werden, unter Einhaltung einer Frist von mindestens einundzwanzig vollen Tagen einberufen, und alle anderen AHV werden mit einer Frist von mindestens vierzehn vollen Tagen einberufen. Die Gesellschaft hält die vorstehenden Benachrichtigungsfristen angesichts dessen, dass sie den Vorgaben in der Satzung der Gesellschaft entsprechen und folglich nicht die vom UK-Code für JHV und AHV vorgeschriebenen Benachrichtigungsfristen einhalten, für angemessen.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

D. Anteilinhaber-Beziehungen (Fortsetzung)

1. Anteilinhaberversammlungen (Fortsetzung)

In einer Mitteilung, mit der eine Hauptversammlung einberufen wird, sind die Zeit und der Ort der Versammlung anzugeben, die allgemeine Natur der zu behandelnden Tagesordnungspunkte, und es ist in angemessener Weise hervorzuheben, dass ein Anteilinhaber, der zur Teilnahme und Abstimmung berechtigt ist, einen Stimmrechtsvertreter zur Teilnahme, Wortmeldung und Abstimmung an seiner Stelle ernennen kann und dass ein Stimmrechtsvertreter kein Anteilinhaber zu sein braucht. Die Mitteilung muss außerdem Angaben über Verwaltungsratsmitglieder enthalten, die vom Verwaltungsrat für die Bestellung oder Wiederbestellung als Verwaltungsratsmitglieder auf der Versammlung vorgeschlagen werden, oder für die die Gesellschaft ordnungsgemäß über die Absicht informiert wurde, sie für die Bestellung oder Wiederbestellung als Verwaltungsratsmitglied auf der Versammlung vorzuschlagen.

Mindestens zwei Personen, die zur Abstimmung über die Tagesordnungspunkte berechtigt sind und die jeweils ein Anteilinhaber oder ein Stimmrechtsvertreter für einen Anteilinhaber oder ein ordnungsgemäß bevollmächtigter Vertreter eines Anteilinhaber sind, stellen für alle Zwecke eine beschlussfähige Mehrheit dar.

Ein auf der Versammlung zur Abstimmung vorgelegter Beschluss wird durch Handzeichen entschieden, es sei denn vor (oder bei der Bekanntgabe des Ergebnisses) der Abstimmung durch Handzeichen wird ordnungsgemäß eine Abstimmung mit Stimmzetteln verlangt. Stimmen können entweder persönlich oder durch einen Stimmrechtsvertreter abgegeben werden. Vorbehaltlich jeglicher Rechte oder Beschränkungen, die einstweilen mit einer Anteilklasse verbunden sind, hat jeder persönlich anwesende Anteilinhaber und jeder Stimmrechtsvertreter bei einer Abstimmung durch Handzeichen eine Stimme, und bei einer Abstimmung mit Stimmzetteln hat jeder persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter anwesende Anteilinhaber eine Stimme für jeden Anteil, dessen registrierter Inhaber er/sie ist. Bei einer Stimmgleichheit, egal ob bei einer Abstimmung durch Handzeichen oder mit Stimmzetteln, hat der Vorsitzende der Versammlung, auf der die Abstimmung durch Handzeichen erfolgt oder auf der die Abstimmung mit Stimmzetteln verlangt wird, eine ausschlaggebende Stimme zusätzlich zu einer anderen Stimme, die er/sie ggf. hat. Ein einfacher Mehrheitsbeschluss ist ein mit einfacher Mehrheit der abgegebenen Stimmen gefasster Beschluss, ein Sonderbeschluss ist ein Beschluss, der mit einer Mehrheit von mindestens 75 Prozent der abgegebenen Stimmen gefasst wird. Die Inhaber der Zeichneranteile haben bei einer Abstimmung mit Stimmzetteln eine Stimme je Zeichneranteil.

In Fällen, in denen es nur einen an einer AHV abstimmungsberechtigten Anteilinhaber in der jeweiligen Klasse oder im jeweiligen Fonds gibt, bildet ein Anteilinhaber der betreffenden Klasse bzw. des betreffenden Fonds die beschlussfähige Mehrheit und ist ein Beschluss, der an Versammlungen von Klassen und Versammlungen von Anteilinhabern in einem Fonds zur Abstimmung vorgelegt wird, mittels Stimmzettel zu fassen.

Eine Abstimmung mit Stimmzetteln kann vom Vorsitzenden auf der Versammlung von mindestens drei (persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter) anwesenden und auf der Versammlung stimmberechtigten Anteilinhabern und/oder von einem oder mehreren (persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter) anwesende(n) Anteilinhaber(n), der/die mindestens ein Zehntel aller auf der Versammlung stimmberechtigten Anteilinhaber repräsentiert/repräsentieren, verlangt werden.

2. Ergebnisse von Hauptversammlungen

Die Gesellschaft veröffentlicht die Ergebnisse von auf Hauptversammlungen vorgeschlagenen Beschlüssen auf <https://www.lgim.com>.

Geschäftsbücher

Wie im Abschnitt „Beschreibung der Obliegenheiten des Verwaltungsrats“ auf den Seiten 18 bis 19 beschrieben, obliegt es dem Verwaltungsrat, eine ordnungsgemäße Buchführung durch die Gesellschaft sicherzustellen. Um dies zu erreichen, hat die Verwaltungsgesellschaft einen Verwalter bestellt, um sicherzustellen, dass die Anforderungen gemäß Section 281 des Companies Act 2014 erfüllt werden.

Die Geschäftsbücher der Gesellschaft werden am Sitz des Verwalters geführt: One Dockland Central, Guild Street, International Financial Services Centre, Dublin 1, D01 E4X0, Irland.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

D. Anteilinhaber-Beziehungen (Fortsetzung)

2. Ergebnisse von Hauptversammlungen (Fortsetzung)

Geschäftsbücher(Fortsetzung)

Der Verwalter ist eine Designated Activity Company, die am 31. Mai 1994 in Irland gegründet wurde und deren Tätigkeit Dienstleistungen in den Bereichen Fondsverwaltung, Rechnungswesen, Registrierung, Transferdienste und damit zusammenhängende Dienstleistungen für Organismen für gemeinsame Anlagen und Investmentfonds sind. Der Verwalter ist von der Zentralbank gemäß dem Investment Intermediaries Act von 1995 zugelassen und reguliert.

Ergebnisse und Dividenden

Die Ergebnisse des Geschäftsjahres sind in der Gesamtergebnisrechnung auf den Seiten 65 bis 71 aufgeführt.

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 wurden die folgenden Ausschüttungen von den nachstehend aufgeführten jeweiligen Fonds (oder ihren Anteilklassen) gezahlt:

Fonds	Anteilklasse	ISIN	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BHZKHS06	2.536.524 \$	2.363.865 \$
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	GBP Distributing ETF	IE00BLRPQN90	1.523.114 £	487.125 £
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	GBP Distributing ETF	IE00BLRPQM83	3.232.153 £	1.231.800 £
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BLRPQP15	3.662.674 \$	1.250.238 \$
L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹	USD Distributing ETF	IE00BLRPQL76	3.989.983 \$	9.829.705 \$
L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹	EUR Hedged Distributing ETF	IE000F472DU7	1.029.151 €	686.243 €
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BLRPRD67	2.812.180 \$	1.582.280 \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BLRPRF81	11.805.835 \$	8.320.226 \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	GBP Hedged Distributing ETF	IE000YPT5PG3	191.514 £	528 £
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	CHF Hedged Distributing ETF	IE000DBHED39	438.135 CHF	n. zutr.
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	EUR Distributing ETF	IE00BMYDM919	1.254.989 €	1.046.931 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BMYDMB35	1.025.574 \$	945.390 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BMYDMC42	776.157 \$	481.220 \$
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BL6K6H97	19.574.745 \$	936.540 \$

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

²Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 wurden keine weiteren Dividenden aus den anderen Fonds gezahlt.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Überblick über Geschäftsentwicklung und -ergebnis

Ein Bericht über das Geschäft ist in den Abschnitten „Informationen über die Gesellschaft“ auf den Seite 4 bis 9 und „Fondsbericht“ auf den Seiten 10 bis 17 enthalten. Der Verwaltungsrat erwartet außer den im Jahresabschluss genannten keine Veränderungen in der Struktur der Gesellschaft oder den Anlagezielen der Fonds.

Der Verwaltungsrat berücksichtigt, dass die Gesellschaft durch die Auflegung von Fonds, die eine Rendite entsprechend der Rendite eines Finanzindex anstreben, längerfristig Wert generiert oder erhält.

Zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 hatte die Gesellschaft keine Beschäftigten.

Nahestehende Personen

Gemäß den Anforderungen in Verordnung 43(1) der OGAW-Vorschriften der Zentralbank wird die Verwaltungsgesellschaft sicherstellen, dass alle mit der Gesellschaft von der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle, dem Anlageverwalter und ihren jeweiligen verbundenen Unternehmen bzw. Konzerngesellschaften (zusammen die „nahestehenden Personen“) durchgeführten Transaktionen nach dem Fremdvergleichsgrundsatz und im besten Interesse der Anteilhaber durchgeführt werden.

In Übereinstimmung mit Verordnung 81(4) der OGAW-Vorschriften der Zentralbank hat sich der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft von Folgendem überzeugt:

- (i) es bestehen Vorkehrungen, die durch schriftliche Verfahren nachgewiesen werden, um sicherzustellen, dass die in Verordnung 43 Absatz 1 vorgeschriebenen Verpflichtungen auf alle Geschäfte mit einer verbundenen Person angewandt werden; und
- (ii) alle Transaktionen mit verbundenen Personen, die während des Zeitraums, auf den sich der Bericht bezieht, getätigt wurden, entsprechen den in Verordnung 43 Absatz 1 festgelegten Verpflichtungen.

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres

Marktbedingungen

Im März 2023 stieg die Volatilität auf den globalen Märkten nach dem Stress bei US-Regionalbanken und der Übernahme der Credit Suisse durch die UBS. Die Fonds des ETF haben kein wesentliches Engagement in US-Regionalbanken oder Engagements in AT1- oder nachrangigen Schuldtiteln der Credit Suisse. Dennoch überwacht der Verwaltungsrat weiterhin laufend die Auswirkung der Marktvolatilität und deren Auswirkung auf die Fonds des ETF.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Die für die in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte und für die in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte erstellten regelmäßigen Angaben sind im ungeprüften Anhang enthalten.

Für die Erstellung dieser regelmäßigen Angaben werden Daten von Drittanbietern verwendet. Wo zutreffend formen diese Daten Dritter die Grundlage für die im ungeprüften Anhang verwendeten Berechnungen. Die Daten Dritter werden unter Lizenz und mit der gesetzlichen Erlaubnis der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um die Richtigkeit der zur Verfügung gestellten Daten sicherzustellen, ist es wichtig zu beachten, dass die Drittdatenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen. Sie können nicht für Schäden haftbar gemacht werden, die sich aus der Nutzung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen, das Sie in die Berechnungen setzen, entstehen. Die Verfügbarkeit von Daten ist nach wie vor eine Herausforderung, und die aufsichtsrechtlichen Vorgaben in Bezug auf den Inhalt der Offenlegungen werden sich unter Umständen weiterentwickeln. Daher sollten die im ungeprüften Anhang enthaltenen Angaben unter Berücksichtigung dieser Faktoren gelesen und verstanden werden.

Bei den in diesem Bericht enthaltenen Finanzprodukten, die die Kriterien für Fonds gemäß Artikel 8 oder 9 der SFDR nicht erfüllen, berücksichtigen die diesen Finanzprodukten zugrunde liegenden Investitionen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Informationen zum Fonds

Am 8. Juli 2022 wurde der L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS von der Zentralbank zugelassen. Der L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ist im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg, Spanien und der Schweiz registriert.

Am 21. Juli 2022 wurden der L&G Hydrogen Economy UCITS ETF, der L&G Clean Energy UCITS ETF, der L&G Battery Value-Chain UCITS ETF, der L&G Cyber Security UCITS ETF und der L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF ebenfalls an der Mexico Stock Exchange gelistet.

Am 22. Juli 2022 wurde die abgesicherte thesaurierende EUR-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF in der Schweiz registriert und an der Swiss SIX Exchange gelistet.

Am 29. Juli 2022 wurden die folgenden Fonds von der Zentralbank zugelassen:

- L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF

Die vorstehenden Fonds sind im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und der Schweiz registriert.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Informationen zum Fonds (Fortsetzung)

Am 7. September 2022 wurden die folgenden Fonds an der LSE sowie an der Swiss SIX Exchange, der Deutschen Börse und der Borsa Italiana gelistet:

- L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF

Am 8. September 2022 wurden die folgenden neuen Fonds der Gesellschaft von der Zentralbank zugelassen:

- L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF
- L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF

Die vorstehenden Fonds sind im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und der Schweiz registriert.

Am 26. Oktober 2022 wurden die folgenden Fonds an der LSE sowie an der Swiss SIX Exchange, der Deutschen Börse und der Borsa Italiana gelistet:

- L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF
- L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF

Am 28. November 2022 wurden der L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF und der L&G Gold Mining UCITS ETF von Artikel 8- in Artikel 6-SFDR-Produkte umkategorisiert. Darüber hinaus wurde der Name des L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF geändert.

Vorvertragliche Anhänge in Übereinstimmung mit den Ebene-2-Anforderungen der SFDR in Bezug auf Fonds, die zuvor als Artikel 8 oder Artikel 9 für die Zwecke der SFDR kategorisiert waren, wurden am 28. November 2022 bei der Zentralbank eingereicht.

Der aktualisierte Nachtrag zum L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF zwecks Hinzufügung abgesicherter Anteilklassen sowie zur Aktualisierung des Tracking Error des Fonds auf 20 Bp wurde von der Zentralbank am 12. Mai 2023 genehmigt.

Der L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF wurde am 2. Juni 2023 von der Zentralbank zugelassen. Der Fonds ist im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und Spanien registriert.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Informationen zum Fonds (Fortsetzung)

Am 21. Juni 2023 wurden die ausschüttenden und die thesaurierenden Anteilklassen des L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF an der Deutschen Börse gelistet.

Am 21. Juni 2023 wurde der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF ebenfalls an der Deutschen Börse gelistet.

Am 22. Juni 2023 wurde die abgesicherte thesaurierende GBP-Anteilklasse des L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF an der LSE gelistet. Die Anteilklasse ist im Vereinigten Königreich registriert.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse im Geschäftsjahr, die eine Auswirkung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 haben.

Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres

Seit dem Ende des Geschäftsjahres am 30. Juni 2023 zahlten die folgenden Fonds die nachstehenden Ausschüttungen:

Fonds	Ex-Tag	Dividendensatz
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF		
USD Distributing ETF	14. September 2023	0,0973 \$
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF		
GBP Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1385 £
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF		
GBP Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1688 £
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF		
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,2197 \$
L&G China CNY Bond UCITS ETF¹		
EUR Hedged Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1200 €
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1158 \$
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF		
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1549 \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF		
CHF Hedged Distributing ETF	20. Juli 2023	0,2155 CHF
GBP Hedged Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1953 £
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,2077 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF		
EUR Distributing ETF	14. September 2023	0,1104 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF		
USD Distributing ETF	14. September 2023	0,0979 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF		
USD Distributing ETF	14. September 2023	0,1942 \$
L&G India INR Government Bond UCITS ETF		
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,2846 \$
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF²		
USD Distributing ETF	14. September 2023	0,0393 \$

¹ Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

² Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Geopolitische Ereignisse

Der Verwaltungsrat überwacht weiterhin laufend die Entwicklungen in Osteuropa sowie alle potenziellen direkten oder indirekten wirtschaftlichen Auswirkungen auf den ETF.

Am 15. August 2023 wurden die ausschüttenden und thesaurierenden Anteilklassen des L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF, des L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF, des L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF, des L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF, des L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF und des L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF an der SIX Swiss Exchange gelistet und in der Schweiz registriert.

Am 17. August 2023 wurden der L&G Artificial Intelligence UCITS ETF, der L&G Clean Water UCITS ETF, der L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF, der L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating Share Class, der L&G India INR Government Bond UCITS ETF und der L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ebenfalls an der mexikanischen Börse notiert.

Die in EUR abgesicherte thesaurierende Anteilklasse des L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF ist zum Vertrieb in Deutschland, Österreich, Italien und Luxemburg zugelassen. Die Anteilklasse wurde in der Schweiz registriert und am 22. August 2023 an der SIX Swiss Exchange gelistet.

Die in CHF abgesicherte thesaurierende Anteilklasse des L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF ist für den Vertrieb in Deutschland und Österreich registriert. Die Anteilklasse wurde in der Schweiz registriert und am 22. August 2023 an der SIX Swiss Exchange gelistet.

Am 29. August wurden die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Fonds in Singapur gemäß dem „Restricted Scheme“ registriert.

Fonds
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF
L&G Clean Energy UCITS ETF
L&G Clean Water UCITS ETF
L&G Cyber Security UCITS ETF
L&G Digital Payments UCITS ETF
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF
L&G China CNY Bond UCITS ETF
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF
L&G Gold Mining UCITS ETF
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF
L&G India INR Government Bond UCITS ETF
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF
L&G ROBO Global Robotics and Automation UCITS ETF

Am 30. August 2023 wurde der L&G Global Brands UCITS ETF von der Zentralbank zugelassen. Der L&G Global Brands UCITS ETF ist im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und Spanien registriert.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Der L&G Global Brands UCITS ETF wurde am 21. September 2023 aufgelegt.

Der L&G Global Brands UCITS ETF wurde am 27. September 2023 sowohl an der LSE als auch an der Borsa Italiana und an der Deutschen Börse gelistet.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres, die eine Auswirkung auf den Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 haben.

Sonstige Informationen

COVID-19

Die Auswirkungen von COVID-19 auf die Gesellschaft und den Geschäftsbetrieb haben im Laufe der Jahre 2022 und 2023 deutlich nachgelassen, nachdem der Impfstoff eingeführt wurde und mildere Virusstämme in den Vordergrund getreten sind. Der Verwaltungsrat überwacht weiterhin die künftigen Entwicklungen in der COVID-19-Pandemie sowie alle potenziellen wirtschaftlichen Auswirkungen auf den ETF auf kontinuierlicher Basis.

Osteuropa

Am 24. Februar 2022 startete Russland eine groß angelegte Invasion der Ukraine, die geopolitische und wirtschaftliche Unsicherheit in der globalen Wirtschaft und auf Finanzmärkten auslöste. Infolgedessen wurden von vielen Ländern Wirtschaftssanktionen erhoben.

Weitere Einzelheiten in Bezug auf das Engagement in russischen Wertpapieren und ihren beizulegenden Zeitwert sind in Anmerkung 12.4 enthalten.

Der Verwaltungsrat überwacht weiterhin laufend die Entwicklungen in Osteuropa sowie alle potenziellen direkten oder indirekten wirtschaftlichen Auswirkungen auf den ETF.

Unabhängige Abschlussprüfer

Ernst & Young haben gemäß Section 383 (2) des Companies Act von 2014 ihre Bereitschaft erklärt, weiter im Amt zu bleiben.

Für den Verwaltungsrat

David Fagan

Verwaltungsratsmitglied

Donard McClean

Verwaltungsratsmitglied

Datum: 25. Oktober 2023

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber vom 30. Juni 2023

Für den Berichtszeitraum vom 1. Juli 2022 bis zum 30. Juni 2023 (der „Berichtszeitraum“)

The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch (die „Verwahrstelle“, „wir“, „uns“ bzw. „unser“) hat sich in ihrer Eigenschaft als Verwahrstelle der Gesellschaft über das Geschäftsverhalten der Legal & General UCITS ETF Plc (die „Gesellschaft“) im Berichtszeitraum informiert.

Dieser Bericht, einschließlich des Prüfvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Gesellschaft gemäß unserer Aufgabe als Verwahrstelle der Gesellschaft und zu keinem anderen Zweck erstellt. Durch die Erteilung dieses Prüfvermerks übernehmen wir keine Verantwortung für einen anderen Zweck oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht gezeigt wird.

Aufgaben der Verwahrstelle

Unsere Aufgaben und Pflichten sind in Vorschrift 34 der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Kapitalanlagen betreffend) von 2011 (Durchführungsverordnung Nr. 352 von 2011), in der jeweils gültigen Fassung (die „Vorschriften“) dargelegt.

In unserem Bericht erklären wir, ob unserer Meinung nach die Gesellschaft in diesem Berichtszeitraum gemäß den Bestimmungen der Gründungsdokumente der Gesellschaft und den Vorschriften geführt wurde. Die Einhaltung dieser Bestimmungen obliegt der Gesellschaft. Andernfalls müssen wir als Verwahrstelle angeben, in welcher Hinsicht das nicht der Fall war, und die Schritte anführen, die wir diesbezüglich unternommen haben.

Grundlage des Prüfvermerks der Verwahrstelle

Die Verwahrstelle führt die Prüfungen durch, die sie nach vernünftigem Ermessen für notwendig hält, um ihre Pflichten erfüllen zu können und um sicherzustellen, dass die Gesellschaft in jeder wesentlichen Hinsicht (i) gemäß den Beschränkungen ihrer Anlage- und Kreditbefugnisse geführt wurde, die ihr durch ihre Gründungsdokumente und die entsprechenden Vorschriften auferlegt wurden, und (ii) auch ansonsten gemäß den Gründungsdokumenten der Gesellschaft und den entsprechenden Vorschriften geführt wurde.

Prüfvermerk

Unseres Erachtens wurde die Gesellschaft in diesem Berichtszeitraum in allen wesentlichen Aspekten gemäß folgenden Bestimmungen geführt:

- (i) gemäß den Beschränkungen in der Gründungsurkunde und Satzung (Gründungsdokumente) und den Vorschriften bezüglich der Anlage- und Kreditaufnahmebefugnisse der Gesellschaft; und
- (ii) auch ansonsten gemäß den Bestimmungen der Gründungsdokumente und den Vorschriften.

Für und im Namen von The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Riverside II,
Sir John Rogerson's Quay
Grand Canal Dock
Dublin 2
D01 E4X0
Irland

Datum: 25. Oktober 2023

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Gesellschafter der Legal & General UCITS ETF Plc

Bericht über die Abschlussprüfung

Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Legal & General UCITS ETF Plc (die „Gesellschaft“) für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 geprüft, der aus der Gesamtergebnisrechnung, der Bilanz, der Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, der Kapitalflussrechnung und den Anmerkungen zum Jahresabschluss, einschließlich der Zusammenfassung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze in Anmerkung 1, besteht. Der für seine Aufstellung verwendete Rahmen für die Finanzberichterstattung waren das irische Recht und die International Financial Reporting Standards (IFRS), wie sie in der Europäischen Union anzuwenden sind.

Unserer Auffassung nach vermittelt der Jahresabschluss:

- ein zum 30. Juni 2023 den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und der Finanzlage der Gesellschaft und des Gewinns für das dann endende Jahr vermitteln;
- ist ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit IFRS, wie sie in der Europäischen Union anzuwenden sind, erstellt worden und
- wurde ordnungsgemäß aufgestellt gemäß den Bestimmungen des Companies Act 2014, der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 und der Vorschriften des Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Abschnitt 48(1)) betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren von 2019.

Grundlage des Prüfvermerks

Wir haben unsere Prüfung gemäß den International Standards on Auditing (Ireland) (ISAs (Ireland)) und geltendem Recht durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind von der Gesellschaft unabhängig in Übereinstimmung mit den für unsere Prüfung des Jahresabschlusses in Irland geltenden berufsethischen Standards, zu denen der von der Irish Auditing and Accounting Supervisory Authority (IAASA) herausgegebene Ethikstandard, wie er bei Unternehmen des öffentlichen Interesses anzuwenden ist, gehört, und haben unsere sonstigen ethischen Berufspflichten in Übereinstimmung diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung

Bei der Abschlussprüfung haben wir festgestellt, dass es seitens des Verwaltungsrats angemessen ist, bei der Erstellung des Jahresabschlusses von der Unternehmensfortführung auszugehen. Unsere Bewertung der Beurteilung der Fähigkeit der Gesellschaft, auch weiterhin den Rechnungslegungsgrundsatz der Unternehmensfortführung anzuwenden, durch den Verwaltungsrat umfasste:

- Erhärtung unserer Auffassung vom Beurteilungsprozess des Managements zur Unternehmensfortführung und Dialog mit dem Management, um alle wesentlichen Faktoren, die bei der Beurteilung berücksichtigt wurden, zu verstehen;

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Gesellschafter der Legal & General UCITS ETF Plc (Fortsetzung)

Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung (Fortsetzung)

- Einholung der Beurteilung des Managements zur Unternehmensfortführung, die sich auf ein Jahr ab dem Datum der Unterzeichnung dieses Prüfvermerks bezieht.
- Überprüfung und Bewertung der Plausibilität der wesentlichen Faktoren, die vom Management bei seiner Beurteilung zur Unternehmensfortführung berücksichtigt wurden, darunter die künftigen Kapitaltransaktionen der Gesellschaft und die Verfügbarkeit liquider Vermögenswerte zur Deckung der laufenden Betriebskosten. Im Rahmen der Bewertung erlangten und prüften wir die Liquiditätsbedingungen, die die Teilfonds Anlegern bieten, einschließlich einer Überprüfung der Kapitaltransaktionen nach Ablauf des Geschäftsjahrs, und ließen uns durch Nachfrage beim Management bestätigen, ob Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, darunter die Wertentwicklung der Teilfonds, Bedingungen schaffen könnten, die das Management zur Einstellung des Betriebs der Gesellschaft veranlassen könnten.
- Überprüfung der im Jahresbericht enthaltenen Angaben der Gesellschaft zur Unternehmensfortführung, um zu bewerten, ob die Angaben angemessen sind und den Rechnungslegungsgrundsätzen entsprechen.

Schlussfolgerung

Auf der Grundlage unserer Prüfungshandlungen haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder in ihrer Gesamtheit maßgebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft zur Unternehmensfortführung für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab der Freigabe des Jahresabschlusses zur Veröffentlichung wecken könnten.

Unsere Aufgaben und die Aufgaben des Verwaltungsrats in Bezug auf die Unternehmensfortführung sind in den betreffenden Abschnitten dieses Berichts beschrieben. Weil jedoch nicht alle künftigen Ereignisse oder Bedingungen vorhersagbar sind, ist diese Erklärung keine Garantie für die Fähigkeit der Gesellschaft, ihre Geschäfte auch weiterhin fortzuführen.

Die wichtigen Prüfungssachverhalte

Zu den wichtigen Prüfungssachverhalten zählen die Sachverhalte, die nach unserer fachlichen Beurteilung die größte Maßgeblichkeit bei unserer Prüfung des Jahresabschlusses für den laufenden Berichtszeitraum hatten. Sie umfassen die wichtigsten beurteilten Risiken wesentlicher Falschangaben (aufgrund von Betrug oder anderweitig), die von uns ermittelt wurden, einschließlich derjenigen, die die größten Auswirkungen haben auf: die allgemeine Prüfungsstrategie, die Zuweisung von Ressourcen bei der Prüfung und die Ausrichtung der Arbeiten des beauftragten Teams. Diese Sachverhalte wurden im Kontext unserer Prüfung des Jahresabschlusses als Ganzes und bei der Erteilung unseres diesbezüglichen Prüfvermerks behandelt, und wir erteilen keinen separaten Prüfvermerk für diese Sachverhalte.

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Gesellschafter der Legal & General UCITS ETF Plc (Fortsetzung)

Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

Risiken	Unsere Reaktion auf die Risiken	Wichtige Beobachtungen
<p>Bewertung von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</p> <p>Unserer Ansicht nach ist die Bewertung von finanziellen Vermögenswerten mit einem beizulegenden Zeitwert von 14.844.440.617 US\$ (2022: 11.847.697.269 US\$) und von finanziellen Verbindlichkeiten mit einem beizulegenden Zeitwert von 64.864.093 US\$ (2022: 120.439.005 US\$) ein wesentlicher Prüfungssachverhalt, da es sich um eine zentrale Komponente der Gesamtbilanz der Gesellschaft handelt.</p> <p>Bitte beachten Sie die folgenden Anmerkungen zum Jahresabschluss: Anmerkung 1 B. – Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze – Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten; Anmerkung 5 – Sicherheiten; Anmerkung 12 – Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken; und Anmerkung 13 – Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen.</p>	<p>Wir haben die Aufstellung der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 30. Juni 2023 vom Verwalter eingeholt.</p> <p>Wir haben die Angemessenheit der Bewertung aller finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten beurteilt, indem wir wie folgt vorgegangen sind:</p> <ul style="list-style-type: none"> Wir haben ein Verständnis der Schlüsselkontrollen erlangt, die in Bezug auf den Bewertungsprozess für finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingeführt wurden. Dies umfasste die Einholung des Prüfberichts für den Verwalter bezogen auf Dienstleistungsorganisationen und die Identifizierung der Schlüsselkontrollen beim Verwalter im Zusammenhang mit dem Bewertungsprozess. Wir haben die Werte der Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit den notierten Preisen oder den Verkaufspreisen verglichen. Wir haben den beizulegenden Zeitwert von derivativen Finanzinstrumenten und umgekehrten Pensionsgeschäften mithilfe branchenüblicher Modelle neu berechnet und dabei die Angemessenheit der Annahmen und Datenparameter beurteilt, die vom Verwaltungsrat zur Bewertung dieser erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten herangezogen werden. 	<p>Aus der Durchführung unserer Prüfungshandlungen haben wir keine Probleme hinsichtlich dieser wichtigen Prüfungssachverhalte festgestellt.</p>

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Gesellschafter der Legal & General UCITS ETF Plc (Fortsetzung)

Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

Risiken	Unsere Reaktion auf die Risiken	Wichtige Beobachtungen
<p>Eigentum an finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die außerhalb des Depotbankennetzes gehalten werden (derivative Finanzinstrumente und umgekehrte Pensionsgeschäfte)</p> <p>Unserer Ansicht nach ist das Eigentum an finanziellen Vermögenswerten mit einem beizulegenden Zeitwert von 2.190.564.806 US\$ (2022: 1.653.411.130 US\$) und von finanziellen Verbindlichkeiten mit einem beizulegenden Zeitwert von 64.864.093 US\$ (2022: 120.439.005 US\$) ein wesentlicher Prüfungssachverhalt, da es sich um eine zentrale Komponente der Gesamtbilanz der Gesellschaft handelt.</p> <p>Bitte beachten Sie die folgenden Anmerkungen zum Jahresabschluss: Anmerkung 1 B. – Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze – Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten; Anmerkung 5 – Sicherheiten; Anmerkung 12 – Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken; und Anmerkung 13 – Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen.</p>	<p>Wir haben vom Verwalter (BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company) der Gesellschaft zum 30. Juni 2023 eine Portfolioaufstellung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten erhalten, in der die außerhalb des Depotbankennetzes gehaltenen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aufgeführt werden (derivative Finanzinstrumente und umgekehrte Pensionsgeschäfte).</p> <p>Wir haben die Angemessenheit der Existenz aller finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten, die außerhalb des Depotbankennetzes gehalten werden, beurteilt, indem wir wie folgt vorgegangen sind:</p> <ul style="list-style-type: none"> Wir haben ein Verständnis der Schlüsselkontrollen erlangt, die in Bezug auf den Abstimmungsprozess für finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingeführt wurden. Dies umfasste die Einholung des Prüfberichts für den Verwalter bezogen auf Dienstleistungsorganisationen und die Identifizierung der Schlüsselkontrollen beim Verwalter im Zusammenhang mit dem Abstimmungsprozess für die Anlagen. Wir haben direkt von der Gegenpartei der einzelnen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zum Jahresende außerhalb des Depotbankennetzes gehalten wurden, unabhängige Bestätigungen eingeholt, um die Existenz dieser finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zu bestätigen. Bei wesentlichen Unterschieden haben wir Nachforschungen angestellt. 	<p>Aus der Durchführung unserer Prüfungshandlungen haben wir keine Probleme hinsichtlich dieser wichtigen Prüfungssachverhalte festgestellt.</p>

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Gesellschafter der Legal & General UCITS ETF Plc (Fortsetzung)

Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

Anwendung des Wesentlichkeitskriteriums

Im Zuge der Planung und Durchführung der Prüfung, der Beurteilung des Effekts von identifizierten Falschangaben und der Bildung unseres Prüfvermerks haben wir das Konzept der Wesentlichkeit angewendet.

Wesentlichkeit

Die Größenordnung einer fehlenden oder falschen Angabe, bei der vernünftigerweise davon auszugehen ist, dass sie einzeln oder insgesamt die wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen könnte. Das Wesentlichkeitskriterium bietet eine Grundlage für die Festlegung der Art und des Ausmaßes unserer Prüfungshandlungen.

Als Wesentlichkeitsschwelle legten wir 0,5 % des Nettoinventarwerts jedes Teilfonds fest (2022: 0,5 %). Wir sind der Auffassung, dass der Nettoinventarwert eine angemessene Bewertungsbasis darstellt, da Adressaten unter Umständen mehr Wert darauf legen als auf die Erträge.

Während unserer Prüfung führten wir eine Neubeurteilung der anfänglichen Wesentlichkeit durch und beließen sie unverändert.

Performance-Wesentlichkeit

Die Anwendung der Wesentlichkeit auf individueller Konto- oder Saldoebene. Sie wird mit einem Betrag festgesetzt, um die Wahrscheinlichkeit, dass unkorrigierte oder unerkannte Falschangaben in ihrer Gesamtheit die Wesentlichkeitsgrenze überschreiten, auf ein vertretbar niedriges Niveau zu reduzieren.

Auf Grundlage unserer Risikobeurteilungen, zusammen mit unserer Beurteilung der allgemeinen Kontrollumgebung der Gesellschaft, legten wir die Performance-Wesentlichkeit mit 75 % (2022: 75 %) unserer Wesentlichkeit fest. Wir haben diesen Prozentsatz aufgrund unserer Kenntnisse bzgl. der Branche der Gesellschaft sowie wegen der Tatsache festgelegt, dass es sich um eine Folgeprüfung handelt, gewählt.

Meldeschwelle

Ein Betrag, unterhalb dessen identifizierte Falschangaben als eindeutig vernachlässigbar einzustufen sind.

Wir vereinbarten mit dem Verwaltungsrat, dass wir ihm sämtliche unkorrigierten Prüfungsunterschiede, die 5 % unserer definierten Wesentlichkeit übersteigen, sowie sämtliche Unterschiede unterhalb dieser Grenze, die unserer Ansicht nach aus qualitativen Gründen mitgeteilt werden sollten, berichten werden.

Im Zuge der Bildung unseres Prüfvermerks beurteilen wir etwaige unkorrigierte Falschangaben anhand der oben beschriebenen quantitativen Maßnahmen der Wesentlichkeit und mit Blick auf andere relevante qualitative Überlegungen.

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Gesellschafter der Legal & General UCITS ETF Plc (Fortsetzung)

Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

Überblick über den Umfang unseres Prüfberichts

Anpassung des Umfangs

Unsere Beurteilung des Prüfungsrisikos, unsere Einschätzung der Wertentwicklung sowie unsere Zuteilung der Performance-Wesentlichkeit bestimmen den Prüfungsumfang für die Gesellschaft. Das ermöglicht uns, ein Urteil über den Jahresabschluss abzugeben. Im Rahmen der Beurteilung des Umfangs der auszuführenden Arbeiten berücksichtigen wir die Größe, das Risikoprofil und die Organisation der Gesellschaft sowie die Wirksamkeit der Kontrollen, einschließlich der Kontrollen und Veränderungen im Geschäftsumfeld.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Zu den sonstigen Informationen zählen die Informationen im Jahresbericht neben dem Jahresabschluss und unserem Bericht der Abschlussprüfer darüber. Unser Prüfvermerk zum Jahresabschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen und, sofern in unserem Bericht nicht ausdrücklich anderweitig angegeben, geben wir diesbezüglich keinerlei Erklärungen ab.

Wir sind verpflichtet, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei abzuwägen, ob die sonstigen Angaben in wesentlichem Widerspruch zum Jahresabschluss oder unseren im Prüfungsverlauf erlangten Erkenntnissen stehen oder anderweitig eine wesentliche Falschangabe zu enthalten scheinen. Stellen wir solche wesentlichen Widersprüche oder offensichtlich wesentliche Falschangaben fest, sind wir verpflichtet festzustellen, ob wesentliche Falschangaben im Jahresabschluss oder in den sonstigen Informationen vorliegen. Wenn wir auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfungstätigkeiten schlussfolgern, dass diese sonstigen Informationen wesentliche Falschangaben enthalten, sind wir verpflichtet, über diesen Sachverhalt zu berichten.

Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Prüfungsurteile zu sonstigen, im Companies Act 2014 vorgeschriebenen Angelegenheiten

Einzig auf Basis der im Zuge unserer Prüfung durchgeführten Arbeiten berichten wir, dass unserer Ansicht nach:

- die im Bericht des Verwaltungsrats gemachten Angaben für das abgeschlossene Geschäftsjahr, für das der Abschluss erstellt wurde, in Einklang mit dem Jahresabschluss stehen; und
- der Bericht des Verwaltungsrats gemäß geltenden rechtlichen Anforderungen erstellt wurde.

Wir haben alle Angaben und Erklärungen eingeholt, die nach bestem Wissen und Gewissen für die Zwecke unserer Prüfung notwendig sind.

Unserer Auffassung nach waren die Geschäftsbücher der Gesellschaft ausreichend, um jederzeit eine ordnungsgemäße Prüfung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, und der Jahresabschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Gesellschafter der Legal & General UCITS ETF Plc (Fortsetzung)

Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

Überblick über den Umfang unseres Prüfberichts (Fortsetzung)

Angelegenheiten, über die wir ausnahmsweise zu berichten haben

Auf Basis der Kenntnisse und des Verständnisses von der Gesellschaft und ihrem Umfeld, die/das wir im Laufe der Abschlussprüfung gewonnen haben, haben wir im Bericht des Verwaltungsrats keine wesentlichen Falschangaben festgestellt.

Gemäß dem Companies Act 2014 sind wir verpflichtet, Ihnen mitzuteilen, wenn die Gesellschaft nach unserer Auffassung die in Section 305 bis 312 des Companies Act vorgeschriebenen Angaben zu Vergütungen und Transaktionen des Verwaltungsrats nicht erteilt hat. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Jeweilige Obliegenheiten

Obliegenheiten des Verwaltungsrats in Bezug auf den Jahresabschluss

Wie in der Erklärung über die Obliegenheiten des Verwaltungsrates auf den Seiten 18 und 19 ausführlicher beschrieben, ist der Verwaltungsrat für die Erstellung des Jahresabschlusses gemäß dem anwendbaren Rahmen für die Rechnungslegung verantwortlich und dafür, dass der Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt, sowie für die internen Kontrollen, die nach Maßgabe des Verwaltungsrats erforderlich sind, um die Aufstellung eines Abschlusses zu ermöglichen, der keine wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – Falschangaben enthält.

Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit zu beurteilen, gegebenenfalls Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit anzugeben sowie dafür, den Rechnungslegungsgrundsatz der Fortführung der Unternehmenstätigkeit anzuwenden, es sei denn, das Management beabsichtigt, entweder die Gesellschaft zu liquidieren oder die Unternehmenstätigkeit einzustellen, oder sie hat keine realistische Alternative dazu.

Obliegenheiten des Abschlussprüfers in Bezug auf die Prüfung des Jahresabschlusses

Unsere Ziele bestehen darin, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – Falschangaben ist und einen Bericht der Abschlussprüfer herauszugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine gemäß den ISAs (Irland) durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche Falschangabe, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falschangaben können aus Verstößen und Unrichtigkeiten resultieren und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Gesellschafter der Legal & General UCITS ETF Plc (Fortsetzung)

Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

Überblick über den Umfang unseres Prüfberichts (Fortsetzung)

Erläuterung, inwieweit die Prüfung geeignet war, Unregelmäßigkeiten (einschließlich Betrug) aufzudecken

Unregelmäßigkeiten (einschließlich Betrug) sind Fälle der Nichteinhaltung von Rechtsvorschriften. Wir konzipieren Verfahren gemäß unseren oben dargelegten Verantwortlichkeiten, um Unregelmäßigkeiten (einschließlich Betrug) aufzudecken, von denen vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie wesentliche Auswirkungen auf den Abschluss haben. Das Risiko, dass eine wesentliche Falschangabe aufgrund von Betrug nicht aufgedeckt wird, ist höher als das Risiko, dass eine aus einem Irrtum resultierende Darstellung nicht aufgedeckt wird, da Betrug eine vorsätzliche Verschleierung beinhalten kann, beispielsweise durch Fälschung, eine absichtliche Falschangabe oder durch geheime Absprachen. Des Weiteren ist es umso unwahrscheinlicher, dass unsere Verfahren etwaige Verstöße aufdecken, je weiter diese von den im Abschluss ausgewiesenen Ereignissen und Transaktionen entfernt sind. Im Folgenden wird erläutert, inwieweit unsere Verfahren geeignet sind, Unregelmäßigkeiten (einschließlich Betrug) aufzudecken. Die Hauptverantwortung für die Verhinderung und Aufdeckung von Betrug liegt jedoch sowohl bei den bei der Gesellschaft für die Überwachung Verantwortlichen als auch beim Management.

Unser Ansatz war folgender:

- Wir haben ein Verständnis über die für die Gesellschaft anwendbaren rechtlichen und regulatorischen Rahmenbedingungen gewonnen und festgelegt, dass die wichtigsten Rechtsvorschriften die des irischen Companies Act 2014, die Bestimmungen bezogen auf Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß der irischen Verordnung European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011 und die irische Verordnung The Central Bank (Supervision And Enforcement) Act 2013 (Section 48(1) (Undertakings For Collective Investment In Transferable Securities) Regulations 2019) sind;
- Wir haben nachvollzogen, wie Legal & General UCITS ETF Plc diese Rahmenbedingungen einhält, indem wir unser Verständnis in Bezug auf das bestehende angemessene interne Kontrollsystem auf den neuesten Stand gebracht haben. Ferner betrachteten wir das Bestehen unabhängiger Dienstleister, die ordnungsgemäße Funktionstrennung und das regulierte Umfeld, in dem die Gesellschaft tätig ist, was die Möglichkeiten von Verstößen reduzieren könnte.
- Wir beurteilten die Anfälligkeit des Jahresabschlusses der Gesellschaft bezüglich Falschangaben, unter anderem wie Verstöße durch eine Außerkraftsetzung der Kontrollen durch das Management begangen werden könnten.
- Auf der Grundlage dieses Verständnisses planten wir unsere Prüfungshandlungen so, dass wir die Nichteinhaltung solcher Rechtsvorschriften identifizieren können. Unsere Prüfungshandlungen beinhalteten Nachfragen bei den für die Überwachung Verantwortlichen in Bezug auf mögliche Fälle der Nichteinhaltung von Rechtsvorschriften, die Überprüfung der Verwaltungsratssitzungen im Laufe des Berichtsjahres und die Einholung von Zusicherungen vonseiten des Managements.

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Gesellschafter der Legal & General UCITS ETF Plc (Fortsetzung)

Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

Jeweilige Obliegenheiten

Obliegenheiten des Abschlussprüfers in Bezug auf die Prüfung des Jahresabschlusses

Weitere Beschreibungen unserer Obliegenheiten im Rahmen der Prüfung des Jahresabschlusses finden Sie auf der Webseite der IAASA unter: http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Diese Beschreibung ist Teil unseres Berichts des Abschlussprüfers.

Sonstige Angelegenheiten, zu denen wir Stellung nehmen müssen

Wir wurden vom Verwaltungsrat am 1. April 2020 mit der Prüfung des Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 und nachfolgende Berichtszeiträume bestellt. Die ununterbrochene Mandatsdauer des Abschlussprüfers, einschließlich bereits erfolgter Verlängerungen und erneuter Bestellungen, beträgt 4 Jahre.

Es wurden der Gesellschaft keine gemäß dem Ethical Standard der IAASA verbotenen Nichtprüfungsleistungen erbracht und wir sind weiterhin im Rahmen der Durchführung unserer Prüfung unabhängig von der Gesellschaft.

Unser Prüfvermerk steht in Einklang mit unserem zusätzlichen Bericht an den Prüfungsausschuss.

Der Zweck unserer Prüfungstätigkeit und wem gegenüber wir verantwortlich sind

Unser Bericht erfolgt ausschließlich an die Gesellschafter der Gesellschaft als Gremium gemäß Section 391 des Companies Act 2014. Wir haben unsere Prüfungen vorgenommen, um die Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gegebenenfalls über die Sachverhalte zu informieren, über die wir sie in einem Prüfungsbericht zu informieren verpflichtet sind, und zu keinem anderen Zweck. Soweit im Rahmen der gesetzlichen Vorschriften zulässig, haften wir hinsichtlich unserer Prüfung, unseres Berichts oder der von uns gebildeten Meinungen lediglich gegenüber der Gesellschaft und ihren Gesellschaftern als Gremium.

Kieran Daly

für und im Namen von

Ernst & Young Chartered Accountants and Statutory Audit Firm

Sitz: Dublin

Datum: 25. Oktober 2023

Bilanz der Gesellschaft

	Anm.	Zum 30. Juni 2023 Insgesamt \$	Zum 30. Juni 2022 Insgesamt \$
Vermögenswerte			
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	49.416.635	38.205.264
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	89.843.948	54.963.227
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet			
- Wertpapiere	12	12.500.803.037	10.046.145.229
- Geldmarktinstrumente	12	152.846.305	148.140.910
- Derivative Finanzinstrumente	12	9.718.198	3.703.501
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	2.180.846.608	1.649.707.629
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		65.794.050	29.449.010
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		23.034.559	7.041.906
Sonstige Vermögenswerte		35.917.323	34.956.237
Gesamtvermögenswerte		15.108.220.663	12.012.312.913
Verbindlichkeiten			
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet			
- Derivative Finanzinstrumente	12	(64.864.093)	(120.439.005)
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	(43.643)	(2.062.565)
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	(1.366.918)	(2.811.988)
Fällige gekaufte Wertpapiere		(94.154.609)	(33.391.841)
Fällige Kapitalbeteiligungen		(21.871.717)	(17.615.320)
Sonstige Verbindlichkeiten		(7.572.758)	(5.416.889)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(189.873.738)	(181.737.608)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		14.918.346.925	11.830.575.305

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

David Fagan
Verwaltungsratsmitglied

Donard McClean
Verwaltungsratsmitglied

Genehmigungsdatum: 25. Oktober 2023

Gesamtergebnisrechnung der Gesellschaft

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 Insgesamt \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 Insgesamt \$
Erträge			
Bankzinserträge		292.908	9.548
Dividenderträge		148.271.780	163.449.734
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		103.226.771	55.208.954
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		81.788.982	6.525.284
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	1.031.551.891	(2.560.696.494)
Gesamteinnahmen/(-aufwendungen)		1.365.132.332	(2.335.502.974)
Aufwendungen			
Verwaltungsgebühren	8	(53.383.568)	(58.784.798)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(103.160)	(101.232)
Gesamtaufwendungen		(53.486.728)	(58.886.030)
Nettoerträge/(-aufwendungen)		1.311.645.604	(2.394.389.004)
Finanzaufwendungen			
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	(58.090.949)	(33.055.831)
Bankzinsaufwendungen		(472.463)	(199.161)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	(428.525)
Finanzaufwendungen insgesamt		(58.563.412)	(33.683.517)
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		1.253.082.192	(2.428.072.521)
Quellensteuern		(18.574.679)	(19.866.801)
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor dem sonstigen Gesamtergebnis		1.234.507.513	(2.447.939.322)
Sonstiges Gesamtergebnis			
Umrechnungsdifferenzen		65.230.445	(104.591.000)
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		1.299.737.958	(2.552.530.322)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens der Gesellschaft

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 Insgesamt \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 Insgesamt \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		11.830.575.305	12.938.905.514
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern		1.299.737.958	(2.552.530.322)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	4.951.086.860	6.676.788.630
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(3.163.053.198)	(5.232.588.517)
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		1.788.033.662	1.444.200.113
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		14.918.346.925	11.830.575.305

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Kapitalflussrechnung der Gesellschaft

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 Insgesamt \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 Insgesamt \$
Cashflows-Abfluss aus laufender Geschäftstätigkeit			
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor dem sonstigen Gesamtergebnis		1.234.507.513	(2.447.939.322)
Berichtigung aufgrund von:			
Zinserträge aus Schuldtiteln, Geldmarktinstrumenten, umgekehrten Pensionsgeschäften und Bankzinsen		(185.308.661)	(61.743.786)
Bankzinserträge		472.463	627.686
Ausschüttung an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile		58.090.949	33.055.831
Dividendenerträge		(148.271.780)	(163.449.734)
Quellensteuern		18.574.679	19.866.801
		978.065.163	(2.619.582.524)
(Zunahme)/Abnahme des Vermögens:			
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten		(34.880.721)	(52.512.626)
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		(2.972.099.150)	1.066.328.090
Sonstige Forderungen		2.354.883	(3.036.442)
Zunahme/(Abnahme) der Verbindlichkeiten:			
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten		(1.445.070)	(20.064.930)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		(55.574.912)	119.119.137
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		269.205	(73)
Aufgelaufene Kosten		1.886.661	644.497
		(2.081.423.941)	(1.509.104.871)
Mittelabfluss aus der Geschäftstätigkeit.			
Zinserträge aus Schuldtiteln, Geldmarktinstrumenten, umgekehrten Pensionsgeschäften und Bankzinsen		183.590.524	53.585.050
Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten		(472.463)	(627.686)
Vereinnahmte Dividenden		128.099.273	142.073.024
		(1.770.206.607)	(1.314.074.483)
Mittelzufluss aus der Finanzierungstätigkeit			
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile		(58.090.949)	(33.055.831)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen*	6	4.935.094.207	6.688.456.551
Rücknahmen rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile*	6	(3.158.796.803)	(5.256.623.255)
		1.718.206.455	1.398.777.465
Netto(abnahme)/-zunahme von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten			
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente am Anfang des Geschäftsjahres		36.142.699	56.030.717
Umrechnungsdifferenzen		65.230.445	(104.591.000)
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente einschließlich Kontokorrentverbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres		49.372.992	36.142.699

* Die Angabe der Veränderungen der als finanzielle Verbindlichkeiten klassifizierten rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile während des Geschäftsjahres findet sich in Anmerkung 6.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz

Zum 30. Juni 2023

		30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023
	Anm.	L&G Gold Mining UCITS ETF \$	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	L&G Cyber Security UCITS ETF \$	L&G Battery Value-Chain UCITS ETF \$	L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$
Vermögenswerte								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	264.898	–	1.898.863	34.937.734	3.029.261	133.061	385.319
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	180.000	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	129.923.429	–	1.042.273.681	2.519.706.263	1.041.226.726	46.423.205	254.116.510
- Geldmarktinstrumente	12	–	2.895.109	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	192.143	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	30.889.828	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	–	–	3.322.781	–	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		35.524	12.901	829.911	–	1.052.818	27.766	139.002
Gesamtvermögenswerte		130.223.851	34.169.981	1.045.002.455	2.557.966.778	1.045.308.805	46.584.032	254.640.831
Verbindlichkeiten								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	(246.980)	(30.848.412)	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	(2.560.413)	(972.376)	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(73.245)	(55.741)	(706.289)	(1.407.427)	(407.624)	(23.684)	(101.201)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(73.245)	(55.741)	(953.269)	(34.816.252)	(1.380.000)	(23.684)	(101.201)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		130.150.606	34.114.240	1.044.049.186	2.523.150.526	1.043.928.805	46.560.348	254.539.630

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

	Anm.	30. Juni 2023 L&G Clean Water UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ €	30. Juni 2023 L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ \$	30. Juni 2023 L&G Clean Energy UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £
Vermögenswerte								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	1.147.467	157.715	25.756	177.474	806.065	275.204	65.626
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	443.086.775	410.454.058	123.319.062	394.390.019	1.353.811.782	213.221.199	93.492.345
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	99.612	–	–	–	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		1.121.438	385.715	20.176	234.641	653.443	14.302	1.488.776
Gesamtvermögenswerte		445.355.680	411.097.100	123.364.994	394.802.134	1.355.271.290	213.510.705	95.046.747
Verbindlichkeiten								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	–	–	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		(498.980)	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(177.658)	(156.031)	(48.947)	(51.566)	(129.754)	(88.077)	(7.112)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(676.638)	(156.031)	(48.947)	(51.566)	(129.754)	(88.077)	(7.112)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		444.679.042	410.941.069	123.316.047	394.750.568	1.355.141.536	213.422.628	95.039.635

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

	Anm.	30. Juni 2023 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	30. Juni 2023 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹ \$	30. Juni 2023 L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF \$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	–	31.644	157.824	102.438	805.209	1.709.250
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Wertpapiere	12	104.780.799	266.199.198	136.416.652	120.871.795	695.604.148	531.958.563
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	1.126.940	–	–	8.026.314	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		90.281	518.050	1.333.636	–	2.124.100	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		1.871.532	3.607.929	1.755.514	1.281.831	8.914.655	935.901
Gesamtvermögenswerte		106.742.612	271.483.761	139.663.626	122.256.064	715.474.426	534.603.714
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	(458.961)	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	(12.887)	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	(1.501.250)	(1.499.122)	–	(8.846.617)	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(7.773)	(55.519)	(34.586)	(9.020)	(217.785)	(214.216)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(20.660)	(1.556.769)	(1.533.708)	(9.020)	(9.523.363)	(214.216)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		106.721.952	269.926.992	138.129.918	122.247.044	705.951.063	534.389.498

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

	Anm.	30. Juni 2023 L&G ESG Green Bond UCITS ETF ¹ €	30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G Digital Payments UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF \$	30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	–	30.876	48.765	77.756	–	78.796
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	72.280.000	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Wertpapiere	12	–	29.094.949	21.239.030	23.186.855	–	17.606.313
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	118.468.861	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	1.544.114.955	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	527	–	–	–	9.410
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		–	94.014	62.293	–	1.353	205.885
Gesamtvermögenswerte		–	29.220.366	21.350.088	23.264.611	1.734.865.169	17.900.404
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	(53.399.875)	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	(3.145)	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	–	–	–	(2.110)
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		–	(6.084)	(7.074)	(9.263)	(2.117.625)	(88.346)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		–	(6.084)	(7.074)	(9.263)	(55.520.645)	(90.456)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		–	29.214.282	21.343.014	23.255.348	1.679.344.524	17.809.948

¹Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

		30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023
	Anm.	L&G India INR Government Bond UCITS ETF \$	L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF ¹ \$	L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF ² \$	L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ² \$	L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ² \$	L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³ \$	L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³ \$
Vermögenswerte								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	261.115	13.888	5.168	3.769	12.760	2.619	9.492
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	381.066.938	3.684.000	3.794.560	2.611.262	7.796.286	3.860.417	4.166.432
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		7.632.900	283.702	30	1.020	154	1	12
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	526.206	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		5.614.299	1.157	3.044	4.500	4.406	18.726	2.849
Gesamtvermögenswerte		394.575.252	4.508.953	3.802.802	2.620.551	7.813.606	3.881.763	4.178.785
Verbindlichkeiten								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		(7.444.211)	(806.185)	–	–	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(122.985)	(1.275)	(1.811)	(704)	(3.027)	(433)	(470)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(7.567.196)	(807.460)	(1.811)	(704)	(3.027)	(433)	(470)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		387.008.056	3.701.493	3.800.991	2.619.847	7.810.579	3.881.330	4.178.315

¹Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

²Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

³Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

	Anm.	30. Juni 2023 L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF ¹ US\$
Vermögenswerte		
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		
- Wertpapiere	12	15.165.765
- Geldmarktinstrumente	12	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		633
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		360.763
Sonstige Vermögenswerte		12.505
Gesamtvermögenswerte		15.539.666
Verbindlichkeiten		
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		
- Derivative Finanzinstrumente	12	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	(6.030)
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		(184)
Fällige Kapitalbeteiligungen		(360.803)
Sonstige Verbindlichkeiten		(3.300)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(370.317)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		15.169.349

¹Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz

Zum 30. Juni 2022

		30. Juni 2022	30. Juni 2022	30. Juni 2022	30. Juni 2022	30. Juni 2022	30. Juni 2022	30. Juni 2022
	Anm.	L&G Gold Mining UCITS ETF \$	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	L&G Cyber Security UCITS ETF \$	L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	L&G Battery Value-Chain UCITS ETF \$	L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$
Vermögenswerte								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	396.231	–	227.825	4.928.566	–	1.471.619	44.318
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	90.620	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	126.762.821	–	801.566.570	2.467.615.921	–	772.386.992	33.895.308
- Geldmarktinstrumente	12	–	2.341.426	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	29.294.923	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	–	–	–	–	2.682.684	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		135.545	10.587	672.982	–	–	663.384	31.371
Gesamtvermögenswerte		127.294.597	31.737.556	802.467.377	2.472.544.487	–	777.204.679	33.970.997
Verbindlichkeiten								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	(869.132)	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	–	–	–	(1.152.072)	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	(1.472.610)	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(78.168)	(18.614)	(595.494)	(1.470.165)	–	(349.225)	(13.505)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(78.168)	(887.746)	(595.494)	(1.470.165)	–	(2.973.907)	(13.505)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		127.216.429	30.849.810	801.871.883	2.471.074.322	–	774.230.772	33.957.492

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

	Anm.	30. Juni 2022 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Clean Water UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ €	30. Juni 2022 L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ \$	30. Juni 2022 L&G Clean Energy UCITS ETF \$
Vermögenswerte								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	1.180.750	590.259	104.261	–	91.456	511.194	7.138.516
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	262.471.950	307.702.167	223.201.822	125.029.978	91.945.948	858.878.729	175.172.633
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	300.011	62.734	1.429.428	160	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	1.293.744	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		1.034.970	984.993	202.037	19.989	96.732	510.590	62.668
Gesamtvermögenswerte		264.687.670	310.871.174	223.570.854	126.479.395	92.134.296	859.900.513	182.373.817
Verbindlichkeiten								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	(14.874)	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	(1.657.384)	–	–	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	(1.192.582)	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(112.326)	(127.687)	(94.265)	(50.902)	(12.633)	(87.237)	(76.419)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(112.326)	(1.785.071)	(94.265)	(1.258.358)	(12.633)	(87.237)	(76.419)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		264.575.344	309.086.103	223.476.589	125.221.037	92.121.663	859.813.276	182.297.398

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

	Anm.	30. Juni 2022 L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £	30. Juni 2022 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	30. Juni 2022 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹ \$	30. Juni 2022 L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF \$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	6.860	284.218	114.723	75.719	66.362	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Wertpapiere	12	68.259.120	82.924.022	78.334.834	255.069.539	90.144.147	950.856.026
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	3.203	–	–	381.052
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		1.032.520	802.570	2.381.964	2.403.630	2.015.311	11.692.825
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	206.602	–	–	265.437
Sonstige Vermögenswerte		882.501	1.261.637	1.158.447	3.513.675	900.495	14.771.146
Gesamtvermögenswerte		70.181.001	85.272.447	82.199.773	261.062.563	93.126.315	977.966.486
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	(230.420)	–	–	(8.087.405)
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	(1.928.273)
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		(1.279.597)	(595.513)	(2.314.725)	(2.475.523)	(1.664.636)	(14.201.291)
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	(265.714)
Sonstige Verbindlichkeiten		(5.111)	(6.107)	(15.997)	(61.849)	(6.579)	(301.257)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(1.284.708)	(601.620)	(2.561.142)	(2.537.372)	(1.671.215)	(24.783.940)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		68.896.293	84.670.827	79.638.631	258.525.191	91.455.100	953.182.546

¹ Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

	Anm.	30. Juni 2022 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G ESG Green Bond UCITS ETF €	30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Digital Payments UCITS ETF \$
Vermögenswerte						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	1.216.683	14.090.888	45.362	9.597	59.597
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	-	-	-	-	-
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet						
- Wertpapiere	12	495.194.006	8.114.033	21.235.632	20.980.139	11.538.881
- Geldmarktinstrumente	12	-	-	-	-	-
- Derivative Finanzinstrumente	12	-	-	-	-	-
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	-	-	-	-	-
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		-	271.579	726	3.059	-
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		-	-	-	-	-
Sonstige Vermögenswerte		734.093	42.564	16.800	84.197	812
Gesamtvermögenswerte		497.144.782	22.519.064	21.298.520	21.076.992	11.599.290
Verbindlichkeiten						
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet						
- Derivative Finanzinstrumente	12	-	-	-	-	-
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	-	-	-	-	-
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	-	-	-	-	-
Fällige gekaufte Wertpapiere		-	(325.572)	-	-	-
Fällige Kapitalbeteiligungen		-	(14.045.988)	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten		(217.832)	(3.904)	(4.615)	(7.256)	(4.931)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(217.832)	(14.375.464)	(4.615)	(7.256)	(4.931)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		496.926.950	8.143.600	21.293.905	21.069.736	11.594.359

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

	Anm.	30. Juni 2022 L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G India INR Government Bond UCITS ETF \$
Vermögenswerte				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	–	87.161	101.692
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	21.010.000	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
- Wertpapiere	12	–	15.624.024	276.814.385
- Geldmarktinstrumente	12	80.360.375	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	795.902.955	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	7.224	3.807.034
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		74.562	144.079	4.187.979
Gesamtvermögenswerte		897.347.892	15.862.488	284.911.090
Verbindlichkeiten				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
- Derivative Finanzinstrumente	12	(57.878.638)	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	(40.368)	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	(5.453.987)
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(666.302)	(6.111)	(89.932)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)		(58.585.308)	(6.111)	(5.543.919)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		838.762.584	15.856.377	279.367.171

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

		Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	Anm.	L&G Gold Mining UCITS ETF \$	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	L&G Cyber Security UCITS ETF \$	L&G Battery Value-Chain UCITS ETF \$	L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$
Erträge							
Bankzinserträge		2.976	1.817	12.672	67.864	20.636	3.524
Dividendenerträge		3.556.267	–	9.396.870	13.883.479	26.914.290	486.307
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	93.772	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	1.163.166	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	17.615.535	5.727.416	229.915.962	246.094.518	256.534.811	(2.622.035)
Erträge insgesamt		21.174.778	6.986.171	239.325.504	260.045.861	283.469.737	(2.132.204)
Aufwendungen							
Verwaltungsgebühren	8	(849.739)	(85.871)	(6.851.162)	(16.678.811)	(4.337.030)	(234.404)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(769)	(4.339)	(3.000)	(1.609)	(1.498)	(716)
Gesamtaufwendungen		(850.508)	(90.210)	(6.854.162)	(16.680.420)	(4.338.528)	(235.120)
Nettoerträge/(-aufwendungen)		20.324.270	6.895.961	232.471.342	243.365.441	279.131.209	(2.367.324)
Finanzaufwendungen							
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	(2.536.524)	–	–	–	–
Bankzinsaufwendungen		(1.736)	(173)	(7.852)	(163.777)	(14.185)	(203)
Finanzaufwendungen insgesamt		(1.736)	(2.536.697)	(7.852)	(163.777)	(14.185)	(203)
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		20.322.534	4.359.264	232.463.490	243.201.664	279.117.024	(2.367.527)
Quellensteuern		(405.292)	–	(1.468.419)	(1.890.939)	(4.177.393)	(84.995)
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		19.917.242	4.359.264	230.995.071	241.310.725	274.939.631	(2.452.522)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$
Erträge		
Bankzinserträge		6.567
Dividendenerträge		6.807.882
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	32.577.529
Erträge insgesamt		39.391.978
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	8	(1.217.032)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(1.989)
Gesamtaufwendungen		(1.219.021)
Nettoerträge		38.172.957
Finanzaufwendungen		
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–
Bankzinsaufwendungen		(5.506)
Finanzaufwendungen insgesamt		(5.506)
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		38.167.451
Quellensteuern		(1.357.189)
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		36.810.262

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

		Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	Anm.	L&G Clean Water UCITS ETF \$	L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ €	L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ \$	L&G Clean Energy UCITS ETF \$	L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £
Erträge								
Bankzinserträge		12.653	11.832	4.480	862	10.250	8.443	601
Dividendenerträge		7.404.974	1.417.231	348.827	3.155.479	13.854.019	3.994.640	–
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	–	–	–	–	–	2.592.780
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	64.694.385	88.877.084	4.555.689	15.278.694	188.583.217	17.833.491	(4.377.124)
Erträge insgesamt		72.112.012	90.306.147	4.908.996	18.435.035	202.447.486	21.836.574	(1.783.743)
Aufwendungen								
Verwaltungsgebühren	8	(1.891.665)	(1.309.107)	(595.275)	(186.699)	(1.110.442)	(1.165.213)	(82.917)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(1.028)	(1.658)	(1.541)	(4.726)	(3.213)	(3.206)	–
Gesamtaufwendungen		(1.892.693)	(1.310.765)	(596.816)	(191.425)	(1.113.655)	(1.168.419)	(82.917)
Nettoerträge/(-aufwendungen)		70.219.319	88.995.382	4.312.180	18.243.610	201.333.831	20.668.155	(1.866.660)
Finanzaufwendungen								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	(1.523.114)
Bankzinsaufwendungen		(3.260)	(248)	(528)	(836)	(1.168)	(8.242)	(744)
Finanzaufwendungen insgesamt		(3.260)	(248)	(528)	(836)	(1.168)	(8.242)	(1.523.858)
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		70.216.059	88.995.134	4.311.652	18.242.774	201.332.663	20.659.913	(3.390.518)
Quellensteuern		(927.939)	(229.922)	(54.701)	(338.797)	(1.961.285)	(464.122)	(6.279)
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		69.288.120	88.765.212	4.256.951	17.903.977	199.371.378	20.195.791	(3.396.797)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹ \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF \$
Erträge							
Bankzinserträge		75	4.530	10.421	784	12.870	14.628
Dividendenerträge		–	–	–	–	–	8.000.608
Zinserträge aus Schultiteln und Geldmarktinstrumenten		4.747.853	7.660.784	5.148.592	3.763.613	46.491.951	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–
Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(9.084.033)	1.727.955	(15.331.145)	(876.594)	2.200.612	(31.223.557)
Erträge insgesamt		(4.336.105)	9.393.269	(10.172.132)	2.887.803	48.705.433	(23.208.321)
Aufwendungen							
Verwaltungsgebühren	8	(107.209)	(372.715)	(541.120)	(95.837)	(3.325.302)	(2.549.111)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–	–	–	–	–	(1.154)
Gesamtaufwendungen		(107.209)	(372.715)	(541.120)	(95.837)	(3.325.302)	(2.550.265)
Netto(aufwendungen)/-erträge		(4.443.314)	9.020.554	(10.713.252)	2.791.966	45.380.131	(25.758.586)
Finanzaufwendungen							
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	(3.232.153)	(3.662.674)	(5.023.502)	(2.812.180)	(12.503.606)	–
Bankzinsaufwendungen		(13.437)	(3.227)	(22.802)	(1.537)	(172.503)	(4.102)
Finanzaufwendungen insgesamt		(3.245.590)	(3.665.901)	(5.046.304)	(2.813.717)	(12.676.109)	(4.102)
(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		(7.688.904)	5.354.653	(15.759.556)	(21.751)	32.704.022	(25.762.688)
Quellensteuern		(5.022)	(90.175)	–	(3.272)	75.806	(1.039.783)
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(7.693.926)	5.264.478	(15.759.556)	(25.023)	32.779.828	(26.802.471)

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG Green Bond UCITS ETF ¹ €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Digital Payments UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \$
Erträge							
Bankzinserträge		870	142	690	637	39.296	401
Dividendenerträge		–	1.658.242	1.233.353	72.106	–	973.018
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		98.523	–	–	–	4.084.982	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	56.512.808	–
Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(464.715)	2.004.998	(537.955)	3.103.333	(161.910.731)	1.056.373
Erträge insgesamt		(365.322)	3.663.382	696.088	3.176.076	(101.273.645)	2.029.792
Aufwendungen							
Verwaltungsgebühren	8	(15.692)	(68.912)	(81.338)	(88.511)	(4.141.035)	(75.216)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–	(2.406)	(2.707)	(1.110)	(8.160)	(8.071)
Gesamtaufwendungen		(15.692)	(71.318)	(84.045)	(89.621)	(4.149.195)	(83.287)
Netto(aufwendungen)/-erträge		(381.014)	3.592.064	612.043	3.086.455	(105.422.840)	1.946.505
Finanzaufwendungen							
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	(75.990)	(1.254.989)	(1.025.574)	–	–	(776.157)
Bankzinsaufwendungen		(1.356)	(178)	(408)	(548)	(6.608)	(1.280)
Finanzaufwendungen insgesamt		(77.346)	(1.255.167)	(1.025.982)	(548)	(6.608)	(777.437)
(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		(458.360)	2.336.897	(413.939)	3.085.907	(105.429.448)	1.169.068
Quellensteuern		128	(227.819)	(100.963)	(9.271)	–	(125.738)
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(458.232)	2.109.078	(514.902)	3.076.636	(105.429.448)	1.043.330

¹Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G India INR Government Bond UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF ¹ \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF ² \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ² \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ² \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³ \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³ \$
Erträge								
Bankzinserträge		3.990	331	210	378	421	247	10
Dividendenerträge		–	26.316	30.010	19.731	22.566	72.708	24.161
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		23.231.343	–	–	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–	–
Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(5.257.800)	214.935	268.062	494.236	1.201.882	220.733	415.573
Erträge insgesamt		17.977.533	241.582	298.282	514.345	1.224.869	293.688	439.744
Aufwendungen								
Verwaltungsgebühren	8	(1.340.702)	(8.613)	(10.825)	(6.112)	(18.427)	(3.061)	(2.337)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–	(225)	(1.236)	(212)	(388)	(880)	(125)
Gesamtaufwendungen		(1.340.702)	(8.838)	(12.061)	(6.324)	(18.815)	(3.941)	(2.462)
Nettoerträge		16.636.831	232.744	286.221	508.021	1.206.054	289.747	437.282
Finanzaufwendungen								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	(19.574.745)	–	–	–	–	–	–
Bankzinsaufwendungen		(15.931)	(95)	(46)	(6)	(11)	(43)	(23)
Finanzaufwendungen insgesamt		(19.590.676)	(95)	(46)	(6)	(11)	(43)	(23)
(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		(2.953.845)	232.649	286.175	508.015	1.206.043	289.704	437.259
Quellensteuern		–	(3.570)	(4.543)	(3.476)	(3.412)	(2.159)	(3.624)
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(2.953.845)	229.079	281.632	504.539	1.202.631	287.545	433.635

¹Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

²Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

³Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF ¹ \$
Erträge		
Bankzinserträge		–
Dividendenerträge		17.660
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–
Nettogewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	19.564
Erträge insgesamt		37.224
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	8	(3.300)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–
Gesamtaufwendungen		(3.300)
Nettoerträge		33.924
Finanzaufwendungen		
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–
Bankzinsaufwendungen		–
Finanzaufwendungen insgesamt		–
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		33.924
Quellensteuern		(2.335)
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		31.589

¹Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

		Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
	Anm.	L&G Gold Mining UCITS ETF \$	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	L&G Cyber Security UCITS ETF \$	L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	L&G Battery Value-Chain UCITS ETF \$
Erträge							
Bankzinserträge		35	5	140	1.502	–	236
Dividendenerträge		3.486.295	–	10.308.387	44.961.006	–	14.459.184
Zinserträge aus Schultiteln und Geldmarktinstrumenten		–	4.155	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	88.938	–	–	3.232	–
Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(40.517.366)	(559.909)	(379.835.818)	(899.824.960)	449.657	(233.074.225)
Erträge insgesamt		(37.031.036)	(466.811)	(369.527.291)	(854.862.452)	452.889	(218.614.805)
Aufwendungen							
Verwaltungsgebühren	8	(1.039.314)	(85.661)	(9.332.229)	(20.492.375)	(4.591)	(4.435.315)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(1.522)	(5.384)	(4.487)	(2.061)	(944)	(1.436)
Gesamtaufwendungen		(1.040.836)	(91.045)	(9.336.716)	(20.494.436)	(5.535)	(4.436.751)
Netto(aufwendungen)/-erträge		(38.071.872)	(557.856)	(378.864.007)	(875.356.888)	447.354	(223.051.556)
Finanzaufwendungen							
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	(2.363.865)	–	–	–	–
Bankzinsaufwendungen		(4.680)	(546)	(8.556)	(22.186)	(18)	(24.181)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–
Finanzaufwendungen insgesamt		(4.680)	(2.364.411)	(8.556)	(22.186)	(18)	(24.181)
(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		(38.076.552)	(2.922.267)	(378.872.563)	(875.379.074)	447.336	(223.075.737)
Quellensteuern		(399.418)	–	(1.645.809)	(4.939.704)	–	(2.311.051)
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(38.475.970)	(2.922.267)	(380.518.372)	(880.318.778)	447.336	(225.386.788)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$
Erträge			
Bankzinserträge		9	91
Dividendenerträge		299.232	16.378.394
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–
Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(6.798.730)	(141.846.268)
Erträge insgesamt		(6.499.489)	(125.467.783)
Aufwendungen			
Verwaltungsgebühren	8	(170.252)	(2.450.383)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(590)	(1.630)
Gesamtaufwendungen		(170.842)	(2.452.013)
Netto(aufwendungen)/-erträge		(6.670.331)	(127.919.796)
Finanzaufwendungen			
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–
Bankzinsaufwendungen		(143)	(22.420)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–
Finanzaufwendungen insgesamt		(143)	(22.420)
(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		(6.670.474)	(127.942.216)
Quellensteuern		(53.410)	(1.878.453)
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(6.723.884)	(129.820.669)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

		Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
	Anm.	L&G Clean Water UCITS ETF \$	L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ €	L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ \$	L&G Clean Energy UCITS ETF \$
Erträge							
Bankzinserträge		1.965	65	53	3	94	79
Dividendenerträge		5.402.141	1.715.353	513.669	4.068.482	18.756.896	2.396.962
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	–	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–
Nettoverlust aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(75.181.838)	(128.361.312)	(89.238.378)	(6.716.798)	(170.699.143)	(45.489.231)
Erträge insgesamt		(69.777.732)	(126.645.894)	(88.724.656)	(2.648.313)	(151.942.153)	(43.092.190)
Aufwendungen							
Verwaltungsgebühren	8	(1.560.248)	(1.426.343)	(920.501)	(261.987)	(1.824.403)	(703.402)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(1.075)	(1.505)	(1.877)	(2.556)	(3.319)	(2.820)
Gesamtaufwendungen		(1.561.323)	(1.427.848)	(922.378)	(264.543)	(1.827.722)	(706.222)
Nettoaufwendungen		(71.339.055)	(128.073.742)	(89.647.034)	(2.912.856)	(153.769.875)	(43.798.412)
Finanzaufwendungen							
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–
Bankzinsaufwendungen		(4.180)	(920)	(664)	(2.945)	(50)	(4.152)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–
Finanzaufwendungen insgesamt		(4.180)	(920)	(664)	(2.945)	(50)	(4.152)
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		(71.343.235)	(128.074.662)	(89.647.698)	(2.915.801)	(153.769.925)	(43.802.564)
Quellensteuern		(724.499)	(259.132)	(70.023)	(437.433)	(2.725.985)	(311.673)
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(72.067.734)	(128.333.794)	(89.717.721)	(3.353.234)	(156.495.910)	(44.114.237)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹ \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF \$
Erträge							
Bankzinserträge		1	–	30	1.078	6	425
Dividendenerträge		–	–	–	–	–	–
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		717.191	1.436.488	1.786.912	10.847.639	1.921.781	29.392.496
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–
Nettoverlust aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(4.368.267)	(12.899.016)	(10.683.579)	(1.204.005)	(13.780.741)	(210.172.781)
Erträge insgesamt		(3.651.075)	(11.462.528)	(8.896.637)	9.644.712	(11.858.954)	(180.779.860)
Aufwendungen							
Verwaltungsgebühren	8	(59.002)	(66.862)	(143.056)	(1.098.065)	(79.600)	(2.592.489)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–	–	–	–	–	–
Gesamtaufwendungen		(59.002)	(66.862)	(143.056)	(1.098.065)	(79.600)	(2.592.489)
Netto(aufwendungen)/-erträge		(3.710.077)	(11.529.390)	(9.039.693)	8.546.647	(11.938.554)	(183.372.349)
Finanzaufwendungen							
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	(487.125)	(1.231.800)	(1.250.238)	(10.616.191)	(1.582.280)	(8.320.951)
Bankzinsaufwendungen		(205)	(493)	(354)	(15.977)	(306)	(17.726)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–
Finanzaufwendungen insgesamt		(487.330)	(1.232.293)	(1.250.592)	(10.632.168)	(1.582.586)	(8.338.677)
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		(4.197.407)	(12.761.683)	(10.290.285)	(2.085.521)	(13.521.140)	(191.711.026)
Quellensteuern		808	(991)	(20.781)	–	(1.960)	(163.259)
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(4.196.599)	(12.762.674)	(10.311.066)	(2.085.521)	(13.523.100)	(191.874.285)

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
		L&G Hydrogen Economy UCITS ETF \$	L&G ESG Green Bond UCITS ETF €	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	L&G Digital Payments UCITS ETF \$
Erträge						
Bankzinserträge		409	1	—	6	4
Dividendenerträge		7.687.561	—	1.214.831	1.110.876	68.271
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		—	182.335	—	—	—
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		—	—	—	—	—
Nettoverlust aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(268.008.922)	(3.414.919)	(2.229.017)	(4.661.908)	(8.606.498)
Erträge insgesamt		(260.320.952)	(3.232.583)	(1.014.186)	(3.551.026)	(8.538.223)
Aufwendungen						
Verwaltungsgebühren	8	(2.574.290)	(56.872)	(51.941)	(87.208)	(64.655)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(1.764)	—	(2.046)	(2.795)	(633)
Gesamtaufwendungen		(2.576.054)	(56.872)	(53.987)	(90.003)	(65.288)
Nettoaufwendungen		(262.897.006)	(3.289.455)	(1.068.173)	(3.641.029)	(8.603.511)
Finanzaufwendungen						
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	—	(72.145)	(1.046.931)	(945.390)	—
Bankzinsaufwendungen		(21.977)	(124)	(273)	(86)	(186)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		—	—	—	—	—
Finanzaufwendungen insgesamt		(21.977)	(72.269)	(1.047.204)	(945.476)	(186)
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		(262.918.983)	(3.361.724)	(2.115.377)	(4.586.505)	(8.603.697)
Quellensteuern		(1.019.335)	881	(176.892)	(85.614)	(7.007)
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(263.938.318)	(3.360.843)	(2.292.269)	(4.672.119)	(8.610.704)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G India INR Government Bond UCITS ETF \$
Erträge				
Bankzinserträge		87	9	10
Dividendenerträge		–	815.821	–
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		99.924	–	7.929.602
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		2.158.090	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	183.087.549	(3.072.243)	(28.780.493)
Erträge insgesamt		185.345.650	(2.256.413)	(20.850.881)
Aufwendungen				
Verwaltungsgebühren	8	(1.349.663)	(70.512)	(486.612)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(6.092)	(6.523)	–
Gesamtaufwendungen		(1.355.755)	(77.035)	(486.612)
Nettoerträge/(-aufwendungen)		183.989.895	(2.333.448)	(21.337.493)
Finanzaufwendungen				
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	(481.220)	(936.540)
Bankzinsaufwendungen		(17.400)	(2.480)	(6.106)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–
Finanzaufwendungen insgesamt		(17.400)	(483.700)	(942.646)
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern		183.972.495	(2.817.148)	(22.280.139)
Quellensteuern		–	(99.555)	–
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		183.972.495	(2.916.703)	(22.280.139)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

		Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	Anm.	L&G Gold Mining UCITS ETF \$	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	L&G Cyber Security UCITS ETF \$	L&G Battery Value-Chain UCITS ETF \$	L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		127.216.429	30.849.810	801.871.883	2.471.074.322	774.230.772	33.957.492
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		19.917.242	4.359.264	230.995.071	241.310.725	274.939.631	(2.452.522)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	7.869.513	2.620.603	79.488.320	210.668.642	157.861.002	38.173.058
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(24.852.578)	(3.715.437)	(68.306.088)	(399.903.163)	(163.102.600)	(23.117.680)
Netto(abnahme)/-zunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		(16.983.065)	(1.094.834)	11.182.232	(189.234.521)	(5.241.598)	15.055.378
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		130.150.606	34.114.240	1.044.049.186	2.523.150.526	1.043.928.805	46.560.348

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		264.575.344
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		36.810.262
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	23.235.355
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(70.081.331)
Netto(abnahme)/-zunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		(46.845.976)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		254.539.630

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Clean Water UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Clean Energy UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		309.086.103	223.476.589	125.221.037	92.121.663	859.813.276	182.297.398	68.896.293
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		69.288.120	88.765.212	4.256.951	17.903.977	199.371.378	20.195.791	(3.396.797)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	109.543.286	109.559.156	25.943.100	305.626.115	353.634.353	72.960.043	31.373.379
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(43.238.467)	(10.859.888)	(32.105.041)	(20.901.187)	(57.677.471)	(62.030.604)	(1.833.240)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		66.304.819	98.699.268	(6.161.941)	284.724.928	295.956.882	10.929.439	29.540.139
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		444.679.042	410.941.069	123.316.047	394.750.568	1.355.141.536	213.422.628	95.039.635

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹ \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		84.670.827	79.638.631	258.525.191	91.455.100	953.182.546	496.926.950
(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern		(7.693.926)	5.264.478	(15.759.556)	(25.023)	32.779.828	(26.802.471)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	101.777.972	240.400.003	39.060.500	37.244.094	286.988.013	95.623.555
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(72.032.921)	(55.376.120)	(143.696.217)	(6.427.127)	(566.999.324)	(31.358.536)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		29.745.051	185.023.883	(104.635.717)	30.816.967	(280.011.311)	64.265.019
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		106.721.952	269.926.992	138.129.918	122.247.044	705.951.063	534.389.498

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG Green Bond UCITS ETF ² €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Digital Payments UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		8.143.600	21.293.905	21.069.736	11.594.359	838.762.584	15.856.377
(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern		(458.232)	2.109.078	(514.902)	3.076.636	(105.429.448)	1.043.330
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	72.110	16.809.374	2.361.430	10.680.684	1.038.672.837	1.055.635
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(7.757.478)	(10.998.075)	(1.573.250)	(2.096.331)	(92.661.449)	(145.394)
Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen		(7.685.368)	5.811.299	788.180	8.584.353	946.011.388	910.241
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		-	29.214.282	21.343.014	23.255.348	1.679.344.524	17.809.948

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

²Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

		Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	Anm.	L&G India INR Government Bond UCITS ETF \$	L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF ¹ \$	L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF ² \$	L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ² \$	L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ² \$	L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³ \$	L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ³ \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		279.367.171	–	–	–	–	–	–
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(2.953.845)	229.079	281.632	504.539	1.202.631	287.545	433.635
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	150.740.340	5.595.919	5.694.002	5.152.042	8.370.917	6.623.970	4.428.240
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(40.145.610)	(2.123.505)	(2.174.643)	(3.036.734)	(1.762.969)	(3.030.185)	(683.560)
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		110.594.730	3.472.414	3.519.359	2.115.308	6.607.948	3.593.785	3.744.680
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		387.008.056	3.701.493	3.800.991	2.619.847	7.810.579	3.881.330	4.178.315

		Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	Anm.	L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF ⁴ \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		–
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		31.589
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	15.498.513
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(360.753)
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		15.137.760
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		15.169.349

¹Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

²Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

³Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

⁴Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

		Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
	Anm.	L&G Gold Mining UCITS ETF \$	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	L&G Cyber Security UCITS ETF \$	L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	L&G Battery Value-Chain UCITS ETF \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		155.489.496	40.301.424	1.254.865.415	2.792.146.370	11.383.947	834.154.119
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(38.475.970)	(2.922.267)	(380.518.372)	(880.318.778)	447.336	(225.386.788)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	28.241.645	2.931.850	120.983.310	762.737.438	1.798.503	325.373.131
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(18.038.742)	(9.461.197)	(193.458.470)	(203.490.708)	(13.629.786)	(159.909.690)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		10.202.903	(6.529.347)	(72.475.160)	559.246.730	(11.831.283)	165.463.441
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		127.216.429	30.849.810	801.871.883	2.471.074.322	-	774.230.772

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		34.331.501	612.336.023
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(6.723.884)	(129.820.669)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	13.976.800	198.032.470
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(7.626.925)	(415.972.480)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		6.349.875	(217.940.010)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		33.957.492	264.575.344

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Clean Water UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Clean Energy UCITS ETF \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		232.180.626	255.630.405	219.356.536	233.988.889	1.706.212.924	115.243.362
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(72.067.734)	(128.333.794)	(89.717.721)	(3.353.234)	(156.495.910)	(44.114.237)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	160.955.497	155.820.904	47.036.559	6.624.052	56.699.140	136.792.555
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(11.982.286)	(59.640.926)	(51.454.337)	(145.138.044)	(746.602.878)	(25.624.282)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		148.973.211	96.179.978	(4.417.778)	(138.513.992)	(689.903.738)	111.168.273
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		309.086.103	223.476.589	125.221.037	92.121.663	859.813.276	182.297.398

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
		L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £	L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$	L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹ \$	L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF \$	L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		60.138.292	67.397.397	49.902.110	427.341.761	92.756.580	580.089.992
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(4.196.599)	(12.762.674)	(10.311.066)	(2.085.521)	(13.523.100)	(191.874.285)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	14.117.616	35.472.142	44.906.501	166.374.220	20.144.110	1.530.821.431
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(1.163.016)	(5.436.038)	(4.858.914)	(333.105.269)	(7.922.490)	(965.854.592)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		12.954.600	30.036.104	40.047.587	(166.731.049)	12.221.620	564.966.839
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		68.896.293	84.670.827	79.638.631	258.525.191	91.455.100	953.182.546

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
		L&G Hydrogen Economy UCITS ETF \$	L&G ESG Green Bond UCITS ETF €	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	L&G Digital Payments UCITS ETF \$	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF \$
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		459.726.448	23.180.583	16.295.294	19.787.175	6.274.836	-
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(263.938.318)	(3.360.843)	(2.292.269)	(4.672.119)	(8.610.704)	183.972.495
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	312.690.150	4.109.011	8.300.050	5.954.680	13.930.227	699.252.162
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(11.551.330)	(15.785.151)	(1.009.170)	-	-	(44.462.073)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		301.138.820	(11.676.140)	7.290.880	5.954.680	13.930.227	654.790.089
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		496.926.950	8.143.600	21.293.905	21.069.736	11.594.359	838.762.584

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

		Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
		L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \$	L&G India INR Government Bond UCITS ETF \$
	Anm.		
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		–	–
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(2.916.703)	(22.280.139)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	22.788.660	307.278.390
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(4.015.580)	(5.631.080)
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		18.773.080	301.647.310
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		15.856.377	279.367.171

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Anmerkungen zum Jahresabschluss

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

A. Grundlagen der Erstellung

Der Abschluss wurde gemäß den International Financial Reporting Standards, wie sie in der Europäischen Union anzuwenden sind („EU-IFRS“), irischem Recht einschließlich des Companies Act 2014 (in der jeweils gültigen Fassung), den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Vorschriften“) und den Vorschriften des Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Abschnitt 48(1)) betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren von 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) aufgestellt.

Das Management der Gesellschaft hat eine Beurteilung ihrer Fähigkeit zur Unternehmensfortführung vorgenommen und sich vergewissert, dass die Gesellschaft über die Mittel verfügt, ihren Geschäftsbetrieb auf absehbare Zeit fortzuführen. Darüber hinaus sind dem Management keine wesentlichen Unsicherheiten bekannt, die Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft zur Unternehmensfortführung wecken könnten. Der Abschluss wird daher weiterhin unter der Annahme der Unternehmensfortführung (Going-Concern-Prinzip) erstellt. Eine Ausnahme ist der L&G ESG Green Bond UCITS ETF, der am 19. Mai 2023 geschlossen wurde. Bei der Zentralbank wurde ein Antrag auf Widerrufung der Zulassung des Fonds gestellt.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die erfolgswirksame Neubewertung eines beträchtlichen Anteils der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert. Die wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze werden nachstehend beschrieben.

Legal & General UCITS ETF Plc ist das berichtende Unternehmen, und die einzelnen Fonds sind Segmente. Der Abschluss der Gesellschaft auf den Seiten 50 bis 53 stellt die Summe der einzelnen Segmente dar, umgerechnet gemäß Anmerkung 1(H).

Der L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF, der L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF, der L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF, der L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF, der L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF, der L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF und der L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb im Abschluss keine Vergleichswerte enthalten sind.

Ein Geschäftssegment ist eine Gruppe von Vermögenswerten und betrieblichen Aktivitäten, die Produkte oder Dienstleistungen erstellt oder erbringt und Risiken und Erträgen ausgesetzt ist, die sich von denen anderer Geschäftssegmente unterscheiden. Nach Auffassung des Verwaltungsrats können die einzelnen Fonds als Segmente behandelt werden, da der Ertrag jedes Fonds mit einer anderen Gruppe von Vermögenswerten und betrieblichen Aktivitäten in Zusammenhang steht.

Als Hauptentscheidungsträger, der für die Zuteilung von Ressourcen und die Beurteilung der Performance der Geschäftssegmente zuständig ist, ist der Verwaltungsrat bestimmt worden.

Einsatz von Schätzungen und Beurteilungen

Die Erstellung von mit EU-IFRS konformen Abschlüssen erfordert vom Management Beurteilungen, Schätzungen und Annahmen, die sich auf die Anwendung von Grundsätzen und die ausgewiesenen Beträge von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten sowie Erträgen und Aufwendungen auswirken. Die Schätzungen und die damit verbundenen Annahmen beruhen auf Erfahrungswerten und verschiedenen anderen Faktoren, die unter den gegebenen Umständen als angemessen angesehen werden und deren Ergebnisse die Grundlage für die Beurteilung des Buchwerts von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten bilden, der aus anderen Quellen nicht ohne Weiteres ersichtlich ist.

Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen. Die Schätzungen und zugrunde liegenden Annahmen werden laufend überprüft. Berichtigungen von Schätzungen werden in dem Geschäftsjahr erfasst, in dem sie vorgenommen werden, sowie in jedem betroffenen künftigen Geschäftsjahr.

Annahmen und Schätzungsunsicherheiten

Angaben zu Annahmen und Schätzungsunsicherheiten, aufgrund derer ein Risiko besteht, dass in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2023 wesentliche Anpassungen an den Buchwerten von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten vorgenommen werden müssen, finden sich in Anmerkung 12.4. („Zeitwert“) und beziehen sich auf die Bestimmung des Zeitwerts von Finanzinstrumenten mit wesentlichen nicht beobachtbaren Parametern.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

A. Grundlagen der Erstellung (Fortsetzung)

Neue Standards, Änderungen und Auslegungen mit Wirkung für das Geschäftsjahr ab dem 1. Juli 2022

- **Belastende Verträge – Kosten der Vertragserfüllung (Änderungen an IAS 37)**

Der International Accounting Standard („IAS“) 37 Rückstellungen, Eventualverbindlichkeiten und Eventualforderungen stellte nicht klar, welche Kosten bei der Beurteilung, ob ein Vertrag belastend ist, bei der Schätzung der Kosten für die Erfüllung des Vertrags zu berücksichtigen sind. Vom International Financial Reporting Standards („IFRS“) Interpretations Committee durchgeführte Studien ergaben, dass abweichende Einschätzungen zu den zu berücksichtigenden Kosten zu wesentlichen Unterschieden im Abschluss von Unternehmen führen könnten, die bestimmte Arten von Verträgen schließen. In diesem Projekt erarbeitete das International Accounting Standards Board („IASB“) Änderungen an IAS 37, um klarzustellen, dass zur Beurteilung, ob ein Vertrag belastend ist, zu den Kosten der Vertragserfüllung sowohl die durch die Vertragserfüllung zusätzlich entstehenden Kosten als auch sonstige Kosten zählen, die direkt der Vertragserfüllung zurechenbar sind. Das IASB gab die Änderungen im Mai 2020 heraus.

Die Änderungen sind in Kraft für Verträge, für die ein Unternehmen seine Verpflichtungen daraus am oder nach dem 1. Januar 2022 noch nicht vollständig erfüllt hat. Eine vorzeitige Anwendung ist zulässig. Zum 30. Juni 2023 gab es keine belastende Verträge. Die Übernahme der Änderung hatte keine Auswirkung auf den Abschluss der Gesellschaft.

Die Übernahme der obigen Änderungen hatte keine wesentliche Auswirkung auf den Abschluss der Gesellschaft.

Es gibt keine weiteren Standards, Änderungen an Standards oder Interpretationen, die für am oder nach dem 1. Juli 2022 beginnende Geschäftsjahre wirksam sind und wesentliche Auswirkungen auf den Abschluss der Gesellschaft haben.

Neue Standards, Änderungen und Auslegungen, die herausgegeben, aber für das Geschäftsjahr ab dem 1. Juli 2022 noch nicht in Kraft getreten waren und nicht frühzeitig angewendet wurden

- **Änderungen hinsichtlich der Einengung des Anwendungsbereichs von IAS 1, Praxisleitfaden 2 und IAS 8**

Der Zweck der Änderungen ist es, Angaben zu Bilanzierungsgrundsätzen zu verbessern und Adressaten des Abschlusses dabei zu unterstützen, zwischen Änderungen in Schätzungen in der Rechnungslegung und Änderungen in Bilanzierungsgrundsätzen zu unterscheiden.

Die Änderungen gelten für jährliche Berichtsperioden, die am oder nach dem 1. Januar 2023 beginnen. Eine frühere Anwendung ist zulässig.

Die Gesellschaft bewertet derzeit die eventuellen Auswirkungen dieser Änderung auf ihre Abschlüsse.

- **Änderung an IAS 12 – Latente Steuern, die sich auf Vermögenswerte und Verbindlichkeiten beziehen, die aus einer einzigen Transaktion entstehen**

Diese Änderungen erfordern, dass Unternehmen latente Steuern auf Transaktionen ausweisen, die beim Erstansatz zu gleichen Beträgen von steuerpflichtigen und abzugsfähigen temporären Differenzen führen.

Die Änderungen gelten für jährliche Berichtsperioden, die am oder nach dem 1. Januar 2023 beginnen. Eine frühere Anwendung ist zulässig.

Die Gesellschaft bewertet derzeit die eventuellen Auswirkungen dieser Änderung auf ihre Abschlüsse.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

A. Grundlagen der Erstellung (Fortsetzung)

Neue Standards, Änderungen und Auslegungen, die herausgegeben, aber für das Geschäftsjahr ab dem 1. Juli 2022 noch nicht in Kraft getreten waren und nicht frühzeitig angewendet wurden (Fortsetzung)

- **Definition von Schätzungen in der Rechnungslegung (Änderung an IAS 8)**

Im Februar 2021 gab das IASB eine Änderung an IAS 8 heraus, in der es eine Definition von „Schätzungen in der Rechnungslegung“ aufnimmt. Die Änderungen erklären den Unterschied zwischen Änderungen in Schätzungen der Rechnungslegung und Änderungen in Bilanzierungsgrundsätzen und der Korrektur von Fehlern. Sie erklären ebenfalls, wie Unternehmen Bewertungstechniken und Parameter zur Erstellung von Schätzungen in der Rechnungslegung nutzen.

Die Änderungen treten in Kraft für am oder nach dem 1. Januar 2023 beginnende Geschäftsjahre und gelten für Änderungen in Bilanzierungsgrundsätzen und Änderungen von Schätzungen in der Rechnungslegung, die am oder nach dem Beginn dieses Zeitraums erfolgen. Eine frühere Übernahme ist zulässig, solange diese Tatsache offen gelegt wird. Die Änderungen werden voraussichtlich keine wesentliche Auswirkung auf die Gesellschaft haben.

- **Klassifizierung der Verbindlichkeit als langfristig oder kurzfristig (Änderungen zu IAS 1)**

Die Änderungen stellen ein Kriterium in IAS 1 für die Einstufung einer Verbindlichkeit als langfristig klar, und zwar das Erfordernis, dass ein Unternehmen das Recht hat, die Erfüllung der Verbindlichkeit um mindestens 12 Monate nach dem Abschlussstichtag zu verschieben.

Die Änderungen:

- präzisieren, dass das Recht eines Unternehmens, die Erfüllung der Verbindlichkeit zu verschieben, am Ende des Berichtszeitraums bestehen muss;
- stellen klar, dass die Klassifizierung nicht von den Absichten oder Erwartungen des Managements darüber beeinflusst wird, ob das Unternehmen sein Recht auf eine Abwicklung ausüben wird;
- erklären, wie Kreditbedingungen die Klassifizierung beeinflussen und
- erläutern die Anforderungen an die Klassifizierung von Verbindlichkeiten, die ein Unternehmen durch die Ausgabe eigener Eigenkapitalinstrumente abwickeln wird oder kann.

Die Änderungen gelten rückwirkend für jährliche Berichtsperioden, die am oder nach dem 1. Januar 2024 beginnen. Eine frühere Anwendung ist zulässig. Die Gesellschaft bewertet derzeit die eventuellen Auswirkungen dieser Änderung auf ihre Abschlüsse.

- **IFRS S1 - Allgemeine Anforderungen für die Offenlegung nachhaltigkeitsbezogener Finanzinformationen**

Das Ziel von IFRS S1 ist es, ein Unternehmen zur Offenlegung von Informationen über seine nachhaltigkeitsbezogenen Risiken und Chancen zu verpflichten, die für Adressaten von allgemeinen Finanzberichten nützlich beim Treffen von Entscheidungen im Zusammenhang damit sind, dem Unternehmen Kapital zur Verfügung zu stellen. IFRS S1 verlangt von einem Unternehmen, Informationen über sämtliche nachhaltigkeitsbezogenen Risiken und Chancen offen zu legen, von denen vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie sich auf die Zahlungsströme des Unternehmens, auf seinen Zugang zu Finanzierung oder auf kurz-, mittel- oder langfristige Kapitalkosten auswirken könnten (zusammen als die „nachhaltigkeitsbezogenen Risiken und Chancen, von denen vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie sich auf die Aussichten des Unternehmens auswirken“ bezeichnet). IFRS S1 ist wirksam für am oder nach dem 1. Januar 2024 beginnende Berichtsjahre. Eine frühere Anwendung ist zulässig, solange IFRS S2 Klimabezogene Offenlegungen ebenfalls Anwendung findet.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

A. Grundlagen der Erstellung (Fortsetzung)

- **IFRS S2 - Klimabezogene Offenlegungen**

Das Ziel von IFRS S2 ist es, ein Unternehmen zur Offenlegung von Informationen über seine klimabezogenen Risiken und Chancen zu verpflichten, die für Adressaten von allgemeinen Finanzberichten nützlich beim Treffen von Entscheidungen im Zusammenhang damit sind, dem Unternehmen Kapital zur Verfügung zu stellen. IFRS S2 verlangt von einem Unternehmen, Informationen über sämtliche klimabezogenen Risiken und Chancen offen zu legen, von denen vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie sich auf die Zahlungsströme des Unternehmens, auf seinen Zugang zu Finanzierung oder auf kurz-, mittel- oder langfristige Kapitalkosten auswirken könnten (zusammen als die „klimabezogenen Risiken und Chancen, von denen vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie sich auf die Aussichten des Unternehmens auswirken“ bezeichnet). IFRS S2 ist wirksam für am oder nach dem 1. Januar 2024 beginnende Berichtsjahre. Eine frühere Anwendung ist zulässig, solange IFRS S1 Allgemeine Anforderungen für die Offenlegung nachhaltigkeitsbezogener Finanzinformationen ebenfalls Anwendung findet.

Es gibt keine sonstigen herausgegebenen Standards, Änderungen und Auslegungen, die noch nicht in Kraft getreten sind und voraussichtlich erhebliche Auswirkungen auf die Gesellschaft hätten.

B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

(I) Klassifizierung und Bewertung finanzieller Vermögenswerte und finanzieller Verbindlichkeiten:

Beim Erstansatz klassifiziert die Gesellschaft finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten als zu fortgeführten Anschaffungskosten oder erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewerten („FVTPL“).

Ein finanzieller Vermögenswert wird zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet, wenn er die folgenden beiden Bedingungen erfüllt und nicht als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewerten klassifiziert ist:

- Er wird im Rahmen eines Geschäftsmodells gehalten, dessen Ziel darin besteht, Vermögenswerte zu halten, um vertragliche Zahlungsströme zu vereinnahmen und
- sich gemäß seinen vertraglichen Bedingungen zu bestimmten Zeitpunkten Zahlungsströme ergeben, die ausschließlich Tilgungs- und Zinszahlungen aus dem ausstehenden Darlehensbetrag darstellen.

Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten werden, (Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und derivative Finanzinstrumente) und umgekehrte Pensionsgeschäfte werden erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Die Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente sowie die sonstigen Vermögenswerte und sonstigen finanziellen Verbindlichkeiten der Gesellschaft werden zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

Beurteilung des Geschäftsmodells

Bei der Beurteilung der Ziele des Geschäftsmodells, in dessen Rahmen ein finanzieller Vermögenswert gehalten wird, berücksichtigt die Gesellschaft alle einschlägigen Informationen darüber, wie das Geschäft geführt wird, unter anderem:

- die dokumentierte Anlagestrategie und ihre praktische Ausführung. Dazu gehört, ob sich die Anlagestrategie darauf fokussiert, vertragliche Zinserträge zu vereinnahmen, ein bestimmtes Zinssatzprofil aufrechtzuerhalten, die Duration finanzieller Vermögenswerte mit der Duration entsprechender Verbindlichkeiten oder erwarteten Zahlungsmittelabflüssen abzustimmen oder durch die Veräußerung von Vermögenswerten Zahlungsströme zu realisieren;
- wie die Performance des Portfolios bewertet und an das Management der Gesellschaft berichtet wird;
- die Risiken, die sich auf die Performance des Geschäftsmodells auswirken (und auf die finanziellen Vermögenswerte, die im Rahmen dieses Geschäftsmodells gehalten werden) sowie die Art und Weise, wie diese Risiken gemanagt werden;
- wie der Anlageverwalter vergütet wird: z. B., ob die Vergütung auf dem beizulegenden Zeitwert von verwalteten Vermögenswerten oder auf den vereinnahmten vertraglichen Zahlungsströmen beruht und
- die Häufigkeit, der Umfang und die zeitliche Gestaltung von Veräußerungen finanzieller Vermögenswerte in vorangegangenen Perioden, die Gründe für derartige Veräußerungen und die Erwartungen hinsichtlich künftiger Veräußerungen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

(I) Klassifizierung und Bewertung finanzieller Vermögenswerte und finanzieller Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beurteilung des Geschäftsmodells (Fortsetzung)

Übertragungen finanzieller Vermögenswerte an Dritte in Transaktionen, die nicht die Voraussetzungen für eine Ausbuchung erfüllen, gelten in diesem Sinne entsprechend des fortgesetzten Ausweises dieser Vermögenswerte durch die Gesellschaft nicht als Veräußerungen.

Die Gesellschaft hat festgestellt, das in ihrem Fall zwei Geschäftsmodelle vorliegen.

- Geschäftsmodell „Halten bis zur Vereinnahmung vertraglicher Zahlungsströme“: Schließt sonstige Vermögenswerte ein. Diese finanziellen Vermögenswerte werden gehalten, um daraus vertragliche Zahlungsströme zu vereinnahmen.

Das sonstige Geschäftsmodell: Darunter fallen Schuldtitel, Aktienanlagen, umgekehrte Pensionsgeschäfte, derivative Finanzinstrumente und Geldmarktinstrumente. Diese finanziellen Vermögenswerte werden auf Zeitwertbasis gehalten und ihre Performance wird entsprechend bewertet, wobei es häufig zu Veräußerungen kommt.

Beurteilung, ob vertragliche Zahlungsströme ausschließlich Tilgungs- und Zinszahlungen („Solely Payments of Principal and Interest“, „SPPI“) sind

Der „Zins-/Rückzahlungsbetrag“ (principal) wird für die Zwecke dieser Beurteilung als der Zeitwert des finanziellen Vermögenswerts beim Erstansatz definiert. Die „Verzinsung“ (interest) wird definiert als Vergütung für den Zeitwert des Geldes und für das mit dem ausstehenden Kapitalbetrag während eines bestimmten Zeitraums verbundene Ausfallrisiko und für sonstige grundlegende Risiken und Kosten der Kreditvergabe (z. B. Liquiditätsrisiko und Verwaltungskosten) sowie eine Gewinnmarge.

Bei der Beurteilung, ob die vertraglichen Zahlungsströme das SPPI-Kriterium erfüllen, berücksichtigt die Gesellschaft die Vertragsbedingungen des Instruments. Das beinhaltet eine Beurteilung, ob der finanzielle Vermögenswert Vertragsbedingungen aufweist, die die zeitliche Abfolge oder die Höhe vertraglicher Zahlungsströme so verändern könnten, dass diese Voraussetzung nicht erfüllt wäre. Bei dieser Beurteilung berücksichtigt die Gesellschaft:

- eventuelle Ereignisse, die die Höhe oder zeitliche Abfolge von Zahlungsströmen verändern könnten;
- Hebel-Merkmale;
- Merkmale wie vorzeitige Rückzahlung und Prolongation;
- Bedingungen, die den Anspruch der Gesellschaft auf Zahlungsströme aus bestimmten Vermögenswerten beschränken (z. B. Regresslosigkeit) und
- Merkmale, die die Vergütung für den Zeitwert des Geldes modifizieren (z. B. periodische Neufestsetzung von Zinssätzen)

Finanzielle Vermögenswerte, deren vertragliche Zahlungsströme das SPPI-Kriterium erfüllen, werden zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

Umklassifizierungen

Finanzielle Vermögenswerte werden nach ihrem Erstansatz nicht umklassifiziert, es sei denn, die Gesellschaft würde ihr Geschäftsmodell verändern, in dessen Rahmen sie gehalten werden. In diesem Fall würden sämtliche betroffenen finanziellen Vermögenswerte am ersten Tag des ersten Berichtszeitraums nach der Änderung am Geschäftsmodell umklassifiziert.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

(ii) Wertminderung finanzieller Vermögenswerte

Die Gesellschaft setzt die Risikovorsorge für erwartete Kreditverluste aus zu fortgeführten Anschaffungskosten bewerteten finanziellen Vermögenswerten an. Dabei bemisst die Gesellschaft die Risikovorsorge mit einem Betrag, der auf die gesamte Laufzeit des Instruments abgestellt ist, mit folgenden Ausnahmen, bei denen die erwarteten Kreditverluste aus dem Instrument über zwölf Monate zugrunde gelegt werden:

- finanzielle Vermögenswerte, für die zum Bilanzstichtag ein geringes Kreditrisiko ermittelt wird und
- sonstige finanzielle Vermögenswerte, bei denen seit dem Erstansatz keine signifikante Erhöhung des Kreditrisikos (d. h. des Risikos eines Ausfalls über die erwartete Laufzeit des Vermögenswerts) eingetreten ist.

Bei der Beurteilung, ob sich das Kreditrisiko eines finanziellen Vermögenswerts seit dem Erstansatz signifikant erhöht hat und bei der Schätzung der erwarteten Kreditverluste berücksichtigt die Gesellschaft vernünftige und vertretbare einschlägige Informationen, die ohne unangemessene Kosten oder Bemühungen verfügbar sind. Darunter fallen sowohl quantitative als auch qualitative Informationen und Analysen auf der Grundlage von Erfahrungswerten der Gesellschaft sowie fundierte Bonitätsbewertungen, die zukunftsbezogene Angaben beinhalten.

Die Gesellschaft geht davon aus, dass sich das Kreditrisiko eines finanziellen Vermögenswerts signifikant erhöht hat, wenn vertragliche Zahlungen seit mehr als 30 Tagen überfällig sind. Die Gesellschaft erachtet das Kreditrisiko eines finanziellen Vermögenswerts als gering, wenn das Kredit-Rating des Kontrahenten nach allgemeinem Verständnis der Definition von „Investment Grade“ entspricht. Für die Gesellschaft ist das ein Rating von mindestens BBB von Standard & Poor's.

Gesamte, über die Restlaufzeit des Instruments erwartete Kreditverluste sind erwartete Kreditverluste, die sich aus allen möglichen Ausfallereignissen über die Restlaufzeit eines Finanzinstruments ergeben. Erwartete Zwölfmonatsverluste sind der Anteil an erwarteten Kreditverlusten, der sich aus Ausfallereignissen ergibt, die innerhalb der zwölf Monate nach dem Bilanzstichtag eintreten können (oder innerhalb eines kürzeren Zeitraums, wenn die Restlaufzeit des Instruments unter zwölf Monaten liegt). Der bei der Schätzung der erwarteten Kreditverluste maximal berücksichtigte Zeitraum ist die maximale Vertragsdauer, über die die Gesellschaft dem Kreditrisiko ausgesetzt ist.

Bewertung erwarteter Kreditverluste

Erwartete Kreditverluste sind eine wahrscheinlichkeitsgewichtete Schätzung von Kreditverlusten. Kreditverluste werden zum Zeitwert aller Fehlbeträge bewertet (d. h. als Differenz zwischen den dem Unternehmen vertraglich zustehenden Zahlungsströmen und den Zahlungsströmen, die die Gesellschaft zu vereinnahmen erwartet). Erwartete Kreditverluste werden mit dem Effektivzins des finanziellen Vermögenswerts diskontiert.

Finanzielle Vermögenswerte mit objektivem Hinweis auf Wertminderung durch Kreditausfälle

Zu jedem Bilanzstichtag beurteilt die Gesellschaft, ob für die zu fortgeführten Anschaffungskosten bewerteten finanziellen Vermögenswerte objektive Hinweise auf Wertminderungen durch Kreditausfälle vorliegen. Objektive Hinweise auf Wertminderung weist ein finanzieller Vermögenswert dann auf, wenn ein oder mehrere Ereignisse eingetreten sind, die sich negativ auf die geschätzten künftigen Zahlungsströme aus dem finanziellen Vermögenswert auswirken.

Zu objektiven Hinweisen auf Wertminderung eines finanziellen Vermögenswerts gehören die folgenden beobachtbaren Daten:

- erhebliche finanzielle Schwierigkeiten des Schuldners oder Emittenten;
- ein Vertragsbruch wie beispielsweise ein Ausfall oder ein Verzug von mehr als 90 Tagen oder
- eine erhöhte Wahrscheinlichkeit, dass der Kreditnehmer in Insolvenz oder ein sonstiges Sanierungsverfahren geht.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

(ii) Wertminderung finanzieller Vermögenswerte (Fortsetzung)

Ausweis der Risikovorsorge für erwartete Kreditverluste in der Bilanz

Die Risikovorsorge für zu fortgeführten Anschaffungskosten angesetzte finanzielle Vermögenswerte wird vom Bruttobuchwert dieser Vermögenswerte abgezogen.

Abschreibung

Der Bruttobuchwert finanzieller Vermögenswerte wird abgeschrieben, wenn die Gesellschaft nicht mehr begründet von der vollständigen oder teilweisen Realisierbarkeit eines finanziellen Vermögenswerts ausgehen kann.

(iii) Ausbuchung

Die Gesellschaft bucht einen finanziellen Vermögenswert aus, wenn die vertraglichen Rechte auf Zahlungsströme aus dem Vermögenswert erlöschen oder sie die Rechte zur Vereinnahmung vertraglicher Zahlungsströme in einer Transaktion überträgt, mit der im Wesentlichen alle mit dem Eigentum an dem finanziellen Vermögenswert verbundenen Risiken und Chancen übertragen werden oder mit der die Gesellschaft alle mit dem Eigentum verbundenen Risiken und Chancen weder überträgt noch behält und die Verfügungsmacht über den finanziellen Vermögenswert aufgibt

Bei der Ausbuchung eines finanziellen Vermögenswerts wird die Differenz zwischen seinem Buchwert (oder dem dem ausgebuchten Anteil am Vermögenswert zugerechneten Buchwert) und der vereinnahmten Vergütung (einschließlich erhaltener neuer Vermögenswerte abzüglich eingegangener neuer Verbindlichkeiten) in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen. Beteiligungen an solchen übertragenen finanziellen Vermögenswerten, die der Gesellschaft entstehen oder verbleiben, werden als eigenständige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten ausgewiesen. Die Gesellschaft bucht eine finanzielle Verbindlichkeit aus, wenn die vertraglichen Verpflichtungen daraus erfüllt oder aufgehoben oder erloschen sind.

(iv) Grundsätze der Zeitwertbewertung

Der „beizulegenden Zeitwert“ ist der Preis, der in einer geordneten Transaktion zwischen Marktteilnehmern zum Bewertungsdatum auf dem Hauptmarkt oder andernfalls auf dem günstigsten Markt, zu dem die Gesellschaft zu diesem Zeitpunkt Zugang hat, bei einem Verkauf eines Vermögenswerts erzielt bzw. bei der Übertragung einer Verbindlichkeit gezahlt würde. Der beizulegende Zeitwert einer Verbindlichkeit spiegelt ihr Ausfallrisiko wider.

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, sofern diese auf einem aktiven Markt notiert sind, basiert auf ihren notierten Marktkursen zum Bilanzstichtag ohne Abzug geschätzter künftiger Veräußerungskosten. Die Gesellschaft verwendet sowohl für finanzielle Vermögenswerte als auch für finanzielle Verbindlichkeiten den zuletzt gehandelten Marktkurs, wenn die Geld-Brief-Spanne gering ist.

Steht kein aktiver notierter Marktkurs an einer anerkannten Börse oder bei nicht börsengehandelten Finanzinstrumenten von einem Broker/Dealer zur Verfügung, wird der beizulegende Zeitwert des Instruments anhand von Bewertungstechniken geschätzt, zu denen unter anderem zeitnahe ähnliche Transaktionen zu Marktbedingungen, die Bezugnahme auf den aktuellen beizulegenden Zeitwert eines anderen, im Wesentlichen gleichen Instruments, Discounted-Cashflow-Methoden, Optionspreismodelle oder andere Bewertungstechniken zählen, die eine verlässliche Schätzung der bei tatsächlichen Markttransaktionen erzielten Preise liefern.

Werden Discounted-Cashflow-Methoden eingesetzt, basieren die geschätzten künftigen Zahlungsströme auf den besten Schätzungen des Managements und der herangezogene Abzinsungssatz entspricht dem am Bilanzstichtag für ein Instrument mit ähnlichen Vertragsbedingungen geltenden Marktzins. Werden andere Bepreisungsmodelle eingesetzt, basieren die Parameter auf Marktdaten zum Bilanzstichtag. Der beizulegende Zeitwert von nicht notierten Aktienanlagen wird nach Möglichkeit anhand geltender Kurs-Gewinn-Verhältnisse für ähnliche börsennotierte Gesellschaften geschätzt, wobei Anpassungen vorgenommen werden, um die spezifischen Umstände des Emittenten zu berücksichtigen.

Sind solche Preise nicht verfügbar oder scheinen nicht repräsentativ, ist der Wert der betreffenden Anlage der wahrscheinliche Realisationswert, der von einer kompetenten Person, Firma oder Vereinigung, die einen Markt für solche Anlagen macht, und/oder derjenigen anderen Personen, die vom Verwaltungsrat der Gesellschaft beauftragt (und für diesen Zweck von der Verwahrstelle genehmigt) wurde, mit Sorgfalt und nach Treu und Glauben geschätzt wird.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

(v) Bewertung zu fortgeführten Anschaffungskosten

Als „fortgeführte Anschaffungskosten“ eines finanziellen Vermögenswerts oder einer finanziellen Verbindlichkeit wird der Betrag bezeichnet, mit dem ein finanzieller Vermögenswert oder eine finanzielle Verbindlichkeit beim erstmaligen Ansatz bewertet wurde, abzüglich Tilgungen, zuzüglich oder abzüglich der kumulierten Amortisation einer etwaigen Differenz zwischen dem ursprünglichen Betrag und dem bei Endfälligkeit rückzahlbaren Betrag unter Anwendung der Effektivzinsmethode und bei finanziellen Vermögenswerten bereinigt um die Risikovorsorge für erwartete Verluste.

(vi) Derivate – Allgemeines

Ein Derivat ist ein Instrument, dessen Wert sich von einem Basisinstrument, Index, Referenzzinssatz oder einer Kombination aus diesen Faktoren ableitet. Derivative Instrumente können privat ausgehandelte Kontrakte sein, die häufig als „OTC-Derivate“ bezeichnet werden, oder an einer Börse notiert sein und gehandelt werden. Derivatekontrakte können zukünftige Verpflichtungen zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten oder Rohstoffen zu festgelegten Bedingungen an einem festgelegten Datum oder zum Austausch von Zinszahlungsströmen oder Währungen auf Basis eines nominellen oder vertraglich vereinbarten Betrages enthalten.

Derivatekontrakte werden in der Bilanz zum beizulegenden Zeitwert als Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts werden in der Gesamtergebnisrechnung als Komponente des Nettogewinnes/(-verlustes) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden bei Auflösung oder aus periodischen Cashflow-Zahlungen verbucht und in der Gesamtergebnisrechnung als Komponente des Nettogewinnes/(-verlustes) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, ausgewiesen.

(vii) Derivate – OTC-Swaps

Für Fonds mit synthetischer Nachbildung werden OTC-Swap-Kontrakte täglich vom jeweiligen Swap-Kontrahenten bewertet unter Bezugnahme auf die Schlusswerte der vom Fonds nachgebildeten Indizes. Diese Werte werden vom Verwalter anhand der Informationen überprüft, die er von einem unabhängigen externen Datenanbieter bezieht. Hat der Index-Sponsor keinen Wert für den betreffenden Index veröffentlicht oder ist bezüglich eines oder mehrerer Komponenten des betreffenden Index eine Marktstörung eingetreten (etwa eine Unterbrechung des Handels unter anderem durch die Aussetzung des Handels oder durch Handelsbeschränkungen seitens einer relevanten Börse, Börsenunterbrechungen, die dazu führen, dass Marktteilnehmer Transaktionen nicht oder erschwert durchführen oder nicht oder erschwert Marktwerte für die Komponenten des betreffenden Index erhalten können oder einen unvorhergesehenen vorzeitigen Börsenschluss an einer relevanten Börse), kann die Bewertung eines zur Nachbildung eines Index verwendeten OTC-Swaps vom betreffenden Swap-Kontrahenten ermittelt werden durch Bezugnahme auf einen angepassten Indexwert (unter Berücksichtigung der letzten an der Börse gehandelten oder notierten Kurse für die Indexkomponenten und, sofern eine oder mehrere Komponenten nach gewisser Zeit weiterhin gestört sind, nach Treu und Glauben erfolgter Schätzungen des Swap-Kontrahenten für solche Wertpapiere) und/oder auf die Kosten für die Aufrechterhaltung oder Schließung von eingegangenen Absicherungspositionen durch den betreffenden Swap-Kontrahenten im Zusammenhang mit dem Aufbau des OTC-Swap-Engagements.

Im Allgemeinen können OTC-Swaps an eine beliebige Zahl von Basisanlagen und -indizes geknüpft sein und sehr unterschiedliche Konditionen haben. Es werden auf die in den Anlagen oder im Index enthaltenen Basiswerte bezogene Zahlungsmittelflüsse ausgetauscht. Swap-Vereinbarungen werden zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen, und der Wert der Swap-Vereinbarung basiert auf dem vorstehend beschriebenen Bewertungsmodell. Das Modell berücksichtigt verschiedene Parameter, u. a. den beizulegenden Zeitwert der Bestände im Basisindex, die mit den Beständen im Basisindex verbundenen Risiken und die spezifischen Vertragsbedingungen.

Die Nennwerte bestimmter Arten von Finanzinstrumenten, einschließlich OTC-Swaps, bieten eine Grundlage für einen Vergleich mit in der Bilanz verbuchten Finanzinstrumenten. Sie geben jedoch nicht unbedingt einen Hinweis auf die Beträge der betreffenden zukünftigen Zahlungsströme oder auf den aktuellen beizulegenden Zeitwert der Finanzinstrumente und somit auch keinen Hinweis auf das Kredit- oder Marktpreisrisiko eines Fonds. Durch Schwankungen der Marktkurse, Marktzinsen oder Wechselkurse während der Laufzeit erzielen die derivativen Instrumente einen Vorteil (Vermögenswerte) oder einen Nachteil (Verbindlichkeiten).

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

(vii) Derivate – OTC-Swaps (Fortsetzung)

Die Fonds mit synthetischer Nachbildung setzen für die mit der Barclays Bank Plc und Merrill Lynch International eingegangenen OTC-Swaps ein einheitliches Swap-Management-Modell ein. Die OTC-Swaps sind als besicherte Total Return Index Swaps strukturiert, die mit dem jeweiligen Kontrahenten als „Unfunded Swaps“ eingegangen werden. Für jeden OTC-Swap erfolgt ein Reset an einem vorher festgelegten Datum. Der Gewinn bzw. Verlust aus einem Index-Swap wird zum jeweiligen Reset-Datum des Swaps realisiert. Die Barmittel des Fonds werden vom Anlageverwalter in eine Kombination aus umgekehrten Pensionsgeschäften mit demselben Kontrahenten und Geldmarktfonds angelegt. Der Ertrag aus dem umgekehrten Pensionsgeschäft gleicht die Kosten der Finanzierungsseite des Swapgeschäfts weitgehend aus.

An jedem Reset-Datum eines Swaps, zu dem ein neuer Nennbetrag für den Swap festgelegt wird, werden (falls erforderlich) alle Ausgleichszahlungen erstattet, entweder durch Zahlung eines Anteils der umgekehrten Pensionsgeschäfte und/oder durch Rückzahlung eines angemessenen Betrages der Geldmarktfonds. Beachten Sie bitte auch den nachfolgenden Abschnitt *„Im Rahmen einer Wiederverkaufsvereinbarung gekaufte Wertpapiere“* und den Abschnitt *„(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“* im Abschnitt Kreditrisiko von Anmerkung 12 (*„Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken“*).

(viii) Derivative – Währungsabsicherungspolitik

Absicherung auf Portfolioebene

Sofern hierzu in einem Prospektnachtrag Angaben gemacht werden, kann der betreffende Anlageverwalter/Unteranlageverwalter Transaktionen zur Absicherung des Währungsrisikos der Anlagen des Fonds in die Basiswährung abschließen, wenn diese Anlagen auf eine andere Währung lauten. Das Ziel von derlei Absicherungsgeschäften besteht darin, das Risiko auf Fondsebene zu verringern oder das Währungsrisiko in Bezug auf die Währung, auf die einige oder alle Anlagen eines Fonds lauten, abzusichern. Für derartige Absicherungsgeschäfte eines Fonds können Devisenterminkontrakte eingesetzt werden. Das Währungsrisiko, das bei Anlagen des Fonds in Vermögenswerten entsteht, die auf eine andere Währung als seine Basiswährung lauten, wird nicht auf einzelne Anteilklassen aufgeteilt.

Absicherung auf Anteilklassenebene

Sofern im Prospektnachtrag angegeben, kann der Anlageverwalter Strategien zur Absicherung des Währungsrisikos auf Anteilklassenebene verfolgen. So kann er währungsbezogene Transaktionen wie Devisenterminkontrakte einsetzen, um sich gegen bestimmte Währungsrisiken abzusichern, etwa wenn die Währung, auf die eine Anteilklasse lautet, von der Basiswährung oder von den Währungen abweicht, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten.

Allerdings kann nicht zugesichert werden, dass derlei Transaktionen zur Währungsabsicherung effektiv sein werden. Obgleich ein Fonds in Bezug auf jede Anteilklasse Transaktionen zur Währungsabsicherung eingehen kann, ist er dazu nicht verpflichtet, und insoweit er Strategien zur Absicherung bestimmter Anteilklassen einsetzt, kann nicht gewährleistet werden, dass diese auch wirksam sein werden. Die Kosten und die Verbindlichkeiten/Gewinne, die sich aus Instrumenten ergeben, die zum Zwecke der Absicherung des Währungsrisikos zugunsten einer bestimmten Anteilklasse eines Fonds abgeschlossen werden, sind ausschließlich der betreffenden Anteilklasse zuzurechnen.

Das Risiko aus Währungsabsicherungsgeschäften darf 105 % des Nettoinventarwerts („NIW“) der betreffenden Anteilklasse nicht überschreiten. Alle Transaktionen sind eindeutig der jeweiligen Anteilklasse zuzuordnen, und die Währungsrisiken verschiedener Anteilklassen werden nicht miteinander kombiniert oder verrechnet. Die Gesellschaft verfolgt nicht die Absicht, unter- oder überbesicherte Positionen zu halten. Aufgrund von Marktbewegungen und Faktoren, die außerhalb der Kontrolle der Gesellschaft liegen, können sich allerdings von Zeit zu Zeit unter- oder überbesicherte Positionen ergeben.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

(viii) Derivative – Währungsabsicherungspolitik (Fortsetzung)

Absicherung auf Anteilklassenebene (Fortsetzung)

Die abgesicherten Positionen werden laufend überprüft, um sicherzustellen, dass überbesicherte Positionen 105 % des NIW der betreffenden, gegen Währungsrisiken abzusichernden Anteilklasse nicht überschreiten und unterbesicherte Positionen 95 % des Anteils des NIW der betreffenden, gegen Währungsrisiken abzusichernden Anteilklasse nicht unterschreiten. Damit soll sichergestellt werden, dass unterbesicherte Positionen sowie abgesicherte Positionen, die deutlich mehr als 100 % des NIW der betreffenden Anteilklasse ausmachen, nicht von einem auf einen anderen Monat übertragen werden. Für den Fall, dass die Absicherung in Bezug auf eine Anteilklasse 105 % des NIW der betreffenden Anteilklasse über- oder 95 % des Anteils des NIW der betreffenden Anteilklasse unterschreitet, die aufgrund von Marktbewegungen oder Zeichnungen/Rücknahmen gegen das Währungsrisiko abgesichert werden soll, passt der Anlageverwalter diese Absicherung so bald wie möglich danach auf angemessene Weise an.

Bei Devisenterminkontrakten zur Absicherung auf Anteilklassenebene werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den betreffenden Anteilklassen zugewiesen. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Absicherungsgeschäften werden in der Kategorie „Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ in der Bilanz ausgewiesen.

(ix) Im Rahmen einer Wiederverkaufsvereinbarung gekaufte Wertpapiere

Im Rahmen einer Wiederverkaufsvereinbarung gekaufte Wertpapiere (umgekehrte Pensionsgeschäfte) werden in der Bilanz zum beizulegenden Zeitwert bewertet geführt. Sie werden in Anmerkung 5 („Sicherheiten“) angegeben, wobei der entsprechende Kontrahent der Transaktionen genannt wird. Vereinnahmte Zinsen aus umgekehrten Pensionsgeschäften werden über die Laufzeit des jeweiligen Geschäfts ausgewiesen und in der Gesamtergebnisrechnung erfasst.

Die Fonds dürfen ein Finanzinstrument, das als Sicherheit für ein umgekehrtes Pensionsgeschäft entgegengenommen wurde, auch veräußern, ob durch den physischen Verkauf des Vermögenswerts oder im Rahmen der Weiterverwendung für Pensionsgeschäfte. Wird der Vermögenswert physisch verkauft, entsteht daraus eine kurzfristige Short-Position, und der beizulegende Zeitwert dieser Short-Position wird in der Bilanz als Verbindlichkeit ausgewiesen. Ist der Vermögenswert Gegenstand der Weiterverwendung für Pensionsgeschäfte, wird das Pensionsgeschäft und das umgekehrte Pensionsgeschäft zeitgleich mit demselben Kontrahenten abgewickelt, sodass die zugrunde liegenden Sicherheitenpositionen nicht aus den Fondspositionen hervorgehen, weil Hereinnahme und Herausgabe der Sicherheit zum selben Zeitpunkt erfolgen. Die Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften werden zum beizulegenden Zeitwert in der Bilanz ausgewiesen, und die Forderungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften zum beizulegenden Zeitwert geführt.

Sicherheiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte werden täglich marktgerecht bewertet, und bei Bedarf nehmen die Fonds zusätzliche Sicherheiten herein, um sicherzustellen, dass der Wert einschließlich aufgelaufener Zinsen mindestens dem Rückkaufpreis entspricht. Sicherheiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte werden in Anmerkung 5 („Sicherheiten“) in den Anmerkungen zum Jahresabschluss angegeben. Bei Ausfall haben die Fonds ein vertragliches Recht, die Sicherheit zu veräußern und den Erlös zur Begleichung der Verbindlichkeit zu verwenden. Kommt es zum Ausfall des Kontrahenten oder geht dieser in die Insolvenz, kann sich die Veräußerung der Sicherheit durch die Fonds verzögern oder einschränken.

Weitere Informationen zu OTC-Swaps und umgekehrten Pensionsgeschäften, ihren Wechselbeziehungen und den geltenden Sicherheitenvereinbarungen entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“ im Abschnitt Kreditrisiko von Anmerkung 12 („Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken“).

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

(x) Sicherheiten

Ist die Partei, an die die Sicherheit gestellt wird, vertraglich berechtigt, die Sicherheit zu verkaufen oder weiterzuverpfänden, klassifiziert die Gesellschaft diesen Vermögenswert in der Bilanz separat von anderen Vermögenswerten als verpfändeten Vermögenswert.

Ist die Partei, an die die Sicherheit gestellt wird, nicht berechtigt, die Sicherheit zu verkaufen oder weiterzuverpfänden, wird die gestellte Sicherheit in den Anmerkungen zum Jahresabschluss offen gelegt.

Weitere Informationen zu OTC-Swaps und umgekehrten Pensionsgeschäften, ihren Wechselbeziehungen und den geltenden Sicherheitenvereinbarungen entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“ im Abschnitt Kreditrisiko von Anmerkung 12 („Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken“).

(xi) Geldmarktinstrumente

Geldmarktinstrumente bestehen aus kurzfristigen Anlagefonds, die leicht realisiert werden können und ursprüngliche Laufzeiten von bis zu 90 Tagen haben. Diese werden erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

C. Verbuchung der Erträge

Zinserträge auf erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltene verzinsliche Finanzinstrumente für das Geschäftsjahr werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

Zinserträge und Zinsaufwendungen werden periodengerecht über die Laufzeit der Anlage erfasst. Zinsaufwendungen sind durch negative Effektivzinssätze bei umgekehrten Pensionsgeschäften und Geldmarktinstrumenten bedingt und werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

Swap-Zinsen werden als eine Komponente im Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet erfasst.

Die Gesellschaft weist ihre Anlagetransaktionen auf Basis des Handelsdatums aus. Realisierte Gewinne bzw. Verluste aus Index-Swaps werden zum jeweiligen Reset-Datum des Swaps realisiert. Fonds mit physischer Nachbildung nutzen zur Berechnung der realisierten Gewinne und Verluste aus Anlagen die Durchschnittskostenmethode.

Bankzinserträge und -aufwendungen werden in der Gesamtergebnisrechnung periodengerecht ausgewiesen.

D. Dividenderträge

Dividenderträge sind die auf Stammaktien erzielten Erträge und werden in der Gesamtergebnisrechnung an den Terminen ausgewiesen, an denen die betreffenden Wertpapiere „ex-Dividende“ notiert werden. Dividenderträge werden vor Abzug von Quellensteuern ausgewiesen, die nicht zurückgefordert werden können und gesondert in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen werden.

E. Erfassung von Aufwendungen

Alle Aufwendungen werden in der Gesamtergebnisrechnung periodengerecht ausgewiesen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

F. Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile sind auf Verlangen des Anteilinhabers zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile können jederzeit gegen Barzahlung entsprechend dem Anteil am NIW des betreffenden Fonds zurückgegeben werden. Ein rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteil wird zu dem Rücknahmebetrag ausgewiesen, der zum Bilanzstichtag zahlbar ist, wenn der Anteilinhaber von seinem Recht auf Verkauf des Anteils an die Gesellschaft Gebrauch gemacht hat.

Die rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile werden zum aktuellen Wert der Rückzahlungsbeträge bewertet.

G. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile

Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile werden am Ex-Tag in der Gesamtergebnisrechnung als Finanzierungskosten ausgewiesen.

H. Fremdwährung

Der Abschluss der Gesellschaft wird in US-Dollar (US\$) dargestellt, der Währung des primären Wirtschaftsumfeldes, in dem die Gesellschaft tätig ist (ihre „Funktionalwährung“).

Die Gesellschaft betreibt jedoch mehrere Fonds, von denen jeder gemäß Angabe in der Bilanz seine eigene, jeweils festgelegte Funktionalwährung hat, die auch seine Darstellungswährung ist.

Transaktionen eines Fonds, die über Fremdwährungen lauten, werden mit dem am Tag der Transaktion geltenden Wechselkurs in die Funktionalwährung umgerechnet. Der beizulegende Zeitwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und sonstigen monetären Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf andere Währungen als die Funktionalwährung eines Fonds lauten, wurde mit den jeweiligen am Bilanzstichtag geltenden Wechselkursen in diese Funktionalwährung umgerechnet, und daraus resultierende Gewinne oder Verluste wurden in der Gesamtergebnisrechnung verbucht.

Zwecks Vorlage des Abschlusses der Gesamtgesellschaft (wie nach irischem Recht vorgeschrieben) wurden die Beträge im Abschluss jedes Fonds wie folgt neu in dessen Kapitalisierungsspektrums umgerechnet:

- Die Bilanz jedes Fonds wird zu dem am Bilanzstichtag geltenden Wechselkurs in US\$ umgerechnet, und
- die Gesamtergebnisrechnung jedes Fonds, Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen und auf zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile gezahlte Beträge werden zu den durchschnittlichen Kursen umgerechnet, wenn diese Kurse einen angemessenen Annäherungswert zu den tatsächlichen Kursen darstellen.

Die obige Umrechnungsmethode führt zu einem Umrechnungsbetrag. Der nominale Wechselkursgewinn von 65.230.445 US\$ (30. Juni 2022: Wechselkursverlust in Höhe von [104.591.000 US\$]) in der Gesamtergebnisrechnung ist durch die Anwendung von durchschnittlichen Wechselkursen und die Veränderung der Wechselkurse zwischen Beginn und Ende des Bilanzstichtags bedingt. Dies ist eine nominale Wechselkursbereinigung und hat keine Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der einzelnen Fonds.

I. Transaktionskosten

Transaktionskosten werden direkt bei ihrer Entstehung in der Gesamtergebnisrechnung erfasst und im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Transaktionskosten in Zusammenhang mit dem Kauf und Verkauf von Schuldtiteln, Swaps und Geldmarktinstrumenten sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Sie lassen sich nicht ohne Weiteres und auf verlässliche Art ermitteln, da sie in den Kosten der Anlage eingebettet sind, und können nicht gesondert überprüft oder offengelegt werden.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

J. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente umfassen kurzfristige Guthaben und Überziehungen bei The Bank of New York Mellon SA/NV sowie Positionen in den Teilfonds von LGIM Liquidity Funds Plc (LGIM Sterling Liquidity Fund, LGIM US Dollar Liquidity Fund und LGIM Euro Liquidity Fund). Zahlungsmitteläquivalente sind kurzfristige hoch liquide Anlagen, die jederzeit in bekannte Barbeträge umgewandelt werden können und unwesentlichen Wertänderungen unterliegen. Sie werden nicht zu Anlage- oder sonstigen Zwecken gehalten, sondern um kurzfristigen Zahlungsverpflichtungen nachzukommen.

Positionen in anderen Geldmarktfonds („GMF“) werden von der Gesellschaft nicht als Zahlungsmitteläquivalente behandelt, da diese im Regelfall über längere Zeiträume gehalten und ausschließlich zu Besicherungszwecken eingesetzt werden.

K. Saldierung von Finanzinstrumenten

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden erst und nur dann saldiert und netto in der Bilanz ausgewiesen, wenn ein einklagbarer Rechtsanspruch auf Saldierung der ausgewiesenen Beträge vorliegt und die Absicht besteht, auf Nettobasis abzurechnen oder zeitgleich mit der Verwertung des Vermögenswerts die Verbindlichkeit abzulösen.

L. Sonstige Vermögenswerte und sonstige Verbindlichkeiten

Forderungen aus verkauften Wertpapieren/Kapitalanteilen und Verbindlichkeiten für gekaufte Wertpapiere/Kapitalanteile sind Forderungen für verkaufte Wertpapiere/ausgegebene Kapitalanteile bzw. Verbindlichkeiten für gekaufte Wertpapiere/zurückgenommene Kapitalanteile, deren Kauf bzw. Verkauf zwar abgeschlossen ist, die aber am Bilanzstichtag noch nicht abgerechnet bzw. geliefert sind.

Sonstige Vermögenswerte und sonstige Verbindlichkeiten umfassen unter anderem Forderungen und Verbindlichkeiten gegenüber Maklern, wobei es sich um Margenforderungen und -verbindlichkeiten gegenüber Maklern handelt.

M. Zahlungsmittel für Margin-Calls an/von Kontrahenten

Steigt oder fällt der Wert des jeweils von einem Fond nachgebildeten Index, verbuchen die mit einem Swap-Kontrahenten eingegangenen Total Return Index Swaps einen Gewinn oder Verlust für den Fonds. Der Gewinn oder Verlust aus dem Swap wird zwischen der Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) und dem Swap-Kontrahenten monatlich abgerechnet. Innerhalb eines Monats übertragen die Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) und der Swap-Kontrahent jeweils Barsicherheiten (ausschließlich in der Basiswährung des Fonds) in einer Höhe, die dem täglichen Gewinn/Verlust aus dem Index-Swap entspricht, soweit der jeweilige Gewinn/Verlust einen vereinbarten Schwellenbetrag übersteigt. Von dem Swap-Kontrahenten als Sicherheit für den Swap an die Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) übertragene Barmittel werden in der Bilanz als Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten ausgewiesen. Muss die Gesellschaft dagegen (auf Rechnung des betreffenden Fonds) im Rahmen des Swaps Barsicherheiten an den Swap-Kontrahenten übertragen, so ist dies in der Bilanz als Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten ausgewiesen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

2. Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	Insgesamt	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF
	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(561.918.423)	23.605
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(275.402.973)	(85.742.816)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	2.797.875	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	1.807.199.137	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	58.723.942	34.765.199
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	152.333	–
	1.031.551.891	(50.954.012)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	L&G Gold Mining UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	L&G Cyber Security UCITS ETF	L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(16.019.316)	(1)	(21.630.797)	(149.647.917)	13.217.898	(2.430.153)	(16.824.840)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(33.609)	4.666.142	(3.353)	8.065	(79.402)	7.578	8.226
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	9.574	–	(48.838)	(354.072)	(175.582)	(15.155)	(33.044)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	33.656.097	–	251.600.506	396.090.917	243.572.629	(184.247)	49.465.832
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	1.061.275	–	–	3	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	2.789	–	(1.556)	(2.475)	(735)	(58)	(38.645)
	17.615.535	5.727.416	229.915.962	246.094.518	256.534.811	(2.622.035)	32.577.529

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

2. Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Clean Water UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(13.768.109)	(28.198.654)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(3.937)	(1.123)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(83.799)	(16.842)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	78.534.014	117.097.682
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	21	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	16.195	(3.979)
	64.694.385	88.877.084

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G Clean Energy UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 L&G China CNY Bond UCITS ETF ² \$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(23.993.125)	2.874.324	6.226.496	(17.198.473)	(1.170.426)	(11.512.054)	(4.033.184)	(9.686.181)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(206)	–	–	(830)	–	–	(381.545)	21.945
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(2.514)	(42.465)	–	(292.278)	–	–	294.781	(425.425)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	28.551.525	12.445.948	182.356.721	35.325.448	(3.206.697)	2.428.025	4.574.098	(5.287.077)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–	–	–	–	1.273.819	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	9	887	–	(376)	(1)	(4)	(14)	45.593
	4.555.689	15.278.694	188.583.217	17.833.491	(4.377.124)	(9.084.033)	1.727.955	(15.331.145)

²Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

2. Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	L&G ESG Green Bond UCITS ETF ¹	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF
	\$	\$	\$	€	€	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(2.139.247)	(77.907.058)	(159.986.078)	(1.640.365)	(544.288)	(1.578.520)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	–	(4.272.490)	5.045	(56)	–	8.282
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	–	4.906.943	56.984	(787)	(3.515)	(28.441)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	1.262.653	66.995.973	128.671.715	1.175.451	2.552.794	1.060.717
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	12.476.965	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	–	279	28.777	1.042	7	7
	(876.594)	2.200.612	(31.223.557)	(464.715)	2.004.998	(537.955)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	L&G Digital Payments UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	L&G India INR Government Bond UCITS ETF	L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF ²	L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF ³	L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ³	L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ³
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(3.111.072)	(311.540)	(316.170)	(12.155.811)	79.425	157.956	109.749	106.857
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	–	(166.077.951)	(420)	277	–	–	–	232
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	3.137	(3)	(17.166)	(547.587)	(665)	(674)	(725)	(15)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	6.211.468	–	1.396.995	7.328.649	136.211	110.777	385.253	1.094.817
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	4.478.763	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(200)	–	(6.866)	116.672	(36)	3	(41)	(9)
	3.103.333	(161.910.731)	1.056.373	(5.257.800)	214.935	268.062	494.236	1.201.882

¹Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.²Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.³Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

2. Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023
	L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹	L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹	L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF ²
	\$	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	224.176	144.650	10.713
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	24	–	(408)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(1.115)	(1.561)	(675)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(2.294)	272.513	10.006
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(58)	(29)	(72)
	220.733	415.573	19.564

¹Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

²Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

2. Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
	Insgesamt	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF
	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	406.515.782	421.776
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	548.718.169	305.979.767
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(5.089.488)	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(3.356.498.487)	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	(154.188.894)	(81.910.227)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(153.576)	–
	(2.560.696.494)	224.491.316

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
	L&G Gold Mining UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	L&G Cyber Security UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF	L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(8.019.043)	(1)	107.527.566	189.162.732	–	9.710.652	336.967
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(31.616)	(532.738)	(17.700)	(169.164)	800.260	(1.827)	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(7.468)	–	(404.864)	(1.694.118)	–	(443.471)	(4.625)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(32.456.041)	–	(486.944.362)	(1.087.124.501)	–	(242.338.547)	(7.131.196)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	(27.170)	–	–	(350.603)	(3)	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(3.198)	–	3.542	91	–	(1.029)	124
	(40.517.366)	(559.909)	(379.835.818)	(899.824.960)	449.657	(233.074.225)	(6.798.730)

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

2. Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Clean Water UCITS ETF \$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	38.873.031	5.217.945
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	18.480	(11.463)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(242.195)	(44.223)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(180.544.812)	(80.339.604)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	(22)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	49.228	(4.471)
	(141.846.268)	(75.181.838)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Clean Energy UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	11.530.026	(23.079.158)	23.930.606	137.423.318	(2.533.948)	(255.999)	(763.801)	(2.789.303)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	287	51	–	–	(1.790)	–	–	8.095
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(34.000)	(4.856)	(32.051)	11.587	(100.390)	–	–	(163)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(139.857.981)	(66.154.417)	(30.614.396)	(308.134.048)	(42.853.047)	(4.112.268)	(12.135.215)	(7.755.330)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–	–	–	–	–	(146.879)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	356	2	(957)	–	(56)	–	–	1
	(128.361.312)	(89.238.378)	(6.716.798)	(170.699.143)	(45.489.231)	(4.368.267)	(12.899.016)	(10.683.579)

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

2. Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
	L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹	L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	L&G ESG Green Bond UCITS ETF	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF
	\$	\$	\$	\$	€	€
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	7.884.204	(168.888)	(57.869.439)	(40.475.767)	(2.547.111)	213.957
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	23	–	(39.022.530)	1.614	(2.435)	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(101.567)	–	(941.768)	(206.531)	4.489	(4.400)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(8.898.199)	(13.611.853)	(107.429.188)	(227.311.109)	(868.330)	(2.438.593)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	(4.909.613)	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(88.466)	–	(243)	(17.129)	(1.532)	19
	(1.204.005)	(13.780.741)	(210.172.781)	(268.008.922)	(3.414.919)	(2.229.017)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	L&G Digital Payments UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	L&G India INR Government Bond UCITS ETF
	\$	\$	\$	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(298.074)	(1.057.598)	139.584	469.237	(652.577)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	–	97	240.826.603	(10.814)	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(13.754)	(4.789)	–	(40.208)	(427.269)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(4.350.416)	(7.544.230)	–	(3.493.102)	(27.589.437)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	(57.878.638)	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	336	22	–	2.644	(111.210)
	(4.661.908)	(8.606.498)	183.087.549	(3.072.243)	(28.780.493)

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

3. Besteuerung

Die Gesellschaft ist ein Anlageorganismus im Sinne von Section 739B des irischen Taxes Consolidation Act (TCA) von 1997. Daher unterliegt die Gesellschaft keiner irischen Steuer auf ihre Erträge und Gewinne, außer bei Eintritt einer steuerpflichtigen Transaktion.

Im Allgemeinen ergibt sich eine steuerpflichtige Transaktion aus Ausschüttungen, Rücknahmen, Rückkäufen, Stornierungen und Übertragungen von Anteilen oder dem Ende eines „relevanten Zeitraums“. Ein „relevanter Zeitraum“ ist ein achtjähriger Zeitraum, der mit dem Erwerb von Anteilen durch den Anteilinhaber beginnt, und jeder Folgezeitraum von acht Jahren, der unmittelbar nach dem vorherigen relevanten Zeitraum beginnt.

Die folgenden Fälle stellen keinen Gewinn aus einer steuerpflichtigen Transaktion dar:

- a) ein Anteilinhaber, der zum Zeitpunkt der steuerpflichtigen Transaktion weder in Irland ansässig ist noch seinen gewöhnlichen Aufenthalt in Irland hat, vorausgesetzt, der Gesellschaft liegen die entsprechenden, gesetzlich vorgeschriebenen und unterschriebenen Erklärungen vor;
- b) bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anleger, die der Gesellschaft die gesetzlich vorgeschriebenen, unterschriebenen Erklärungen eingereicht haben;
- c) ein Austausch von Anteilen aufgrund einer die Voraussetzungen erfüllenden Fusion oder Restrukturierung der Gesellschaft mit einem anderen Fonds;
- d) Transaktionen in Bezug auf Anteile, die in einem von der irischen Steuerbehörde (Revenue Commissioners of Ireland) als anerkannt bezeichneten Clearing-System gehalten werden;
- e) bestimmte Austauschtransaktionen zwischen Eheleuten und ehemaligen Eheleuten anlässlich einer gerichtlichen Trennung und/oder Scheidung;
- f) ein Tausch von Anteilen der Gesellschaft in andere Anteile der Gesellschaft durch einen Anteilinhaber, der zu Bedingungen erfolgt, die dem Fremdvergleichsgrundsatz folgen, und bei dem keine Zahlung an den Anteilinhaber erfolgt.

Beim Fehlen einer entsprechenden Erklärung unterliegt die Gesellschaft bei Eintritt einer steuerpflichtigen Transaktion irischen Steuern, und die Gesellschaft behält sich das Recht vor, diese Steuern von Zahlungen an die betreffenden Anteilinhaber einzubehalten.

Andere Länder:

Etwaige Zinsen und Veräußerungsgewinne aus von der Gesellschaft getätigten Anlagen können einer Quellensteuer unterliegen, die von dem Land erhoben wird, aus dem die Anlageerträge/-gewinne stammen, und solche Steuern können durch die Gesellschaft oder ihre Anteilinhaber gegebenenfalls nicht zurückgefordert werden.

4. Zahlungsmittel, Zahlungsmitteläquivalente und Kontokorrentverbindlichkeiten

Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente umfassen kurzfristige Guthaben und Überziehungen bei The Bank of New York Mellon SA/NV sowie Positionen in den Teilfonds von LGIM Liquidity Funds Plc (LGIM Sterling Liquidity Fund, LGIM US Dollar Liquidity Fund und LGIM Euro Liquidity Fund).

Die Gesellschaft kann auch Barbestände in der Basiswährung der Fonds oder der Währung halten, auf die die Anlagen lauten.

Die Gesellschaft führt entsprechend dem von der Zentralbank im März 2016 veröffentlichten Leitfaden mit dem Titel „Umbrellafonds – Sammelkonten für Zeichnungs-, Rücknahme- und Dividendengelder“ „Sammelkonten“ auf Umbrellaebene, bei denen es sich um Zeichnungs- und Rücknahmekonten im Namen der Gesellschaft handelt, die auf Umbrellaebene geführt werden und über die Zeichnungs-, Rücknahme- und Dividendengelder sowie Liquidationserlöse von Fonds gezahlt werden.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

4. Zahlungsmittel, Zahlungsmitteläquivalente und Kontokorrentverbindlichkeiten (Fortsetzung)

Auf Fondsebene wurden keine Zeichnungs- und Rücknahmekonten eingerichtet. Es wurden aber mehrere Sammelkonten eingerichtet, jeweils eins für jede der von den Fonds der Gesellschaft genutzten Handelswährungen. Alle Zeichnungsgelder, Rücknahmeerlöse, Dividendenzahlungen und Liquidationszahlungen von Fonds werden über die Sammelkonten gezahlt. Die Salden auf diesen Barsammelkonten zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 werden als unwesentlich in Bezug auf den jeweiligen Fonds erachtet, an den sie fällig sind. Hiervon ausgenommen sind der ETFs Battery Value-Chain UCITS ETF, der L&G Clean Water UCITS ETF und der L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF, die in der Position „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz zum 30. Juni 2023 (L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF und L&G ESG Green Bond UCITS ETF zum 30. Juni 2022) angepasst wurden.

5. Sicherheiten

Im Zusammenhang mit ihren Anlagen in OTC-Swaps können die Fonds mit synthetischer Nachbildung umgekehrte Pensionsgeschäfte eingehen oder Sicherheiten in Form von liquiden Mitteln oder Wertpapieren entgegennehmen.

(i) Für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltene Sicherheiten

In den nachstehenden Tabellen sind die Beträge, die Fonds mit synthetischer Nachbildung als Sicherheit für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhalten haben, sowie der Kontrahent und der beizulegende Zeitwert der entsprechenden umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 aufgeführt:

Fonds	Kontrahent	Beizulegender Zeitwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023	Beizulegender Zeitwert der Sicherheiten zum 30. Juni 2023*	% der Position
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	426.422.859 \$	453.416.478 \$	106 %
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Merrill Lynch International	30.889.828 \$	30.592.384 \$	99 %
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	1.544.114.955 \$	1.635.578.994 \$	106 %
Gesellschaft insgesamt		2.180.846.608 \$	2.303.315.547 \$	

Fonds	Kontrahent	Beizulegender Zeitwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2022	Beizulegender Zeitwert der Sicherheiten zum 30. Juni 2022*	% der Position
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	623.438.724 \$	670.942.217 \$	108 %
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	29.294.923 \$	32.066.181 \$	109 %
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	795.902.955 \$	863.489.204 \$	108 %
Gesellschaft insgesamt		1.649.707.629 \$	1.777.237.675 \$	

* Im Rahmen der umgekehrten Pensionsgeschäften entgegengenommene Sicherheiten setzen sich aus Aktien, Staatsanleihen und supranationalen Anleihen zusammen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

5. Sicherheiten (Fortsetzung)

(ii) Von Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten

Von Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten	Merrill Lynch International Zum 30. Juni 2023	Citigroup Global Markets Limited Zum 30. Juni 2023	Barclays Bank Plc Zum 30. Juni 2023	Gesellschaft insgesamt Zum 30. Juni 2023
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	–	–	14.310.000 \$	14.310.000 \$
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	180.000 \$	–	–	180.000 \$
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	–	–	72.280.000 \$	72.280.000 \$
Gesellschaft insgesamt	1.333.948 \$	–	88.510.000 \$	89.843.948 \$

Von Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten	Merrill Lynch International Zum 30. Juni 2022	Citigroup Global Markets Limited Zum 30. Juni 2022	Barclays Bank Plc Zum 30. Juni 2022	Gesellschaft insgesamt Zum 30. Juni 2022
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	–	–	28.330.000 \$	28.330.000 \$
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	–	90.620 \$	–	90.620 \$
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	–	–	21.010.000 \$	21.010.000 \$
Gesellschaft insgesamt	1.762.607 \$	90.620 \$	53.110.000 \$	54.963.227 \$

(iii) Bei Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten

Barsicherheiten, die bei/von Swap-Kontrahenten hinterlegt wurden, sind als Barmittel für Margin-Calls von/an Kontrahenten in der Bilanz erfasst.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

6. Grundkapital

Bei Gründung betrug das genehmigte Kapital der Gesellschaft 2,00 US\$, aufgeteilt in 2 „Zeichneranteile“ im Nennwert von je 1 US\$ und 500.000.000.000.000.000 nennwertlose Anteile. Die Zeichneranteile sind bei der Berechnung des NIW der jeweiligen Fonds nicht Teil des NIW der Gesellschaft. Sie werden daher im Abschluss nur in Form dieser Anmerkung ausgewiesen. Die Zeichneranteile werden von LGIMH und der Verwaltungsgesellschaft gehalten.

Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber bei einer Abstimmung zu einer Stimme je Zeichneranteil, geben den Inhabern keinen Anspruch auf Dividenden und im Fall einer Abwicklung berechtigen sie die Inhaber zum Erhalt des darauf eingezahlten Betrages, aber nicht zur anderweitigen Beteiligung am Nettovermögen der Gesellschaft. Jeder gewinnberechtigte Anteil der Gesellschaft berechtigt den Inhaber zu einer Stimme je Anteil und auf die vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit beschlossenen Dividenden und hat im Falle der Abwicklung oder Auflösung der Gesellschaft vorrangig vor den Inhabern der Zeichneranteile zunächst Anspruch auf einen Betrag in Höhe des NIW der Anteile jeder Klasse oder Serie, die der Inhaber zum Datum der Abwicklung hält, und, nach Zahlung des eingezahlten Nennwerts an die Inhaber von Zeichneranteilen, Anspruch auf Beteiligung an (etwaigen) überschüssigen Vermögenswerten der Gesellschaft.

Das Kapital aus ausgegebenen und voll eingezahlten rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen entspricht zu jedem Zeitpunkt dem NIW der Gesellschaft. Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile sind auf Verlangen des Anteilinhabers zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert.

Die nachstehende Tabelle weist die zahlenmäßige Veränderung bei gewinnberechtigten Anteilen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 detailliert aus:

Anteilklasse	Eröffnungsbestand – am 1. Juli 2022 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2023 ausgegebene Anteile
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	28.768.433	8.747.500	(16.511.300)	21.004.633
L&G Gold Mining UCITS ETF - USD Accumulating ETF	4.947.093	330.000	(901.000)	4.376.093
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF - USD Distributing ETF	6.856.699	515.000	(728.444)	6.643.255
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF - USD Accumulating ETF	44.725.616	3.700.000	(3.670.000)	44.755.616
L&G Cyber Security UCITS ETF - USD Accumulating ETF	132.256.776	11.008.585	(21.260.000)	122.005.361
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF - USD Accumulating ETF	53.500.000	9.452.000	(10.075.000)	52.877.000
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	3.100.000	3.275.000	(2.068.538)	4.306.462
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF - USD Accumulating ETF	20.282.900	1.625.000	(5.249.000)	16.658.900
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	23.950.000	7.705.000	(3.030.000)	28.625.000

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

6. Grundkapital (Fortsetzung)

Anteilklasse	Eröffnungsbestand – am 1. Juli 2022 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2023 ausgegebene Anteile
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF - USD Accumulating ETF	19.233.500	7.660.000	(850.000)	26.043.500
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	10.500.000	2.100.000	(2.675.000)	9.925.000
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF – EUR Accumulating ETF ¹	7.843.647	22.450.000	(1.635.000)	28.658.647
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	67.635.262	25.055.000	(4.520.000)	88.170.262
L&G Clean Energy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	17.600.000	6.630.000	(5.378.313)	18.851.687
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF	7.315.000	3.367.900	(200.000)	10.482.900
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF - GBP Distributing ETF	10.060.000	12.897.200	(9.020.000)	13.937.200
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF	8.470.400	22.149.996	(6.249.584)	24.370.812
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF	660.000	4.988.358	(194.000)	5.454.358
L&G China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	17.550.609	3.335.724	(6.378.569)	14.507.764
L&G China CNY Bond UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF ²	6.896.085	569.047	(7.356.800)	108.332
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	10.700.000	4.511.560	(760.000)	14.451.560
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF	34.215.208	21.759.944	(35.380.849)	20.594.303
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	7.424.949	1.675.432	(1.172.104)	7.928.277
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – EUR Hedged Accumulating ETF	20.588.941	7.816.292	(9.226.464)	19.178.769
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Accumulating ETF	44.715.497	1.231.389	(18.592.319)	27.354.567
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – GBP Hedged Distributing ETF	513.137	529.293	(282.447)	759.983
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Distributing ETF	1.468.566	407.305	(340.212)	1.535.659
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	92.000.000	17.950.000	(6.030.000)	103.920.000
L&G ESG Green Bond UCITS ETF - EUR Distributing ETF ³	960.239	8.500	(968.739)	–
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF - EUR Distributing ETF	2.334.080	1.630.000	(1.106.500)	2.857.580
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF - USD Distributing ETF	2.500.000	280.000	(200.000)	2.580.000
L&G Digital Payments UCITS ETF - USD Accumulating ETF	2.050.000	1.765.000	(330.000)	3.485.000
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF – USD Accumulating ETF	60.021.282	74.478.200	(6.534.400)	127.965.082
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF - GBP Accumulating ETF ⁴	–	10.000	–	10.000
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF – USD Distributing ETF	1.900.000	130.000	(18.650)	2.011.350
L&G India INR Government Bond UCITS ETF – USD Distributing ETF	30.300.000	16.900.000	(4.520.000)	42.680.000
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁵	–	560.000	(210.000)	350.000
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁶	–	550.000	(206.000)	344.000
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁶	–	500.000	(295.000)	205.000
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁶	–	910.000	(190.000)	720.000
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁷	–	600.000	(259.000)	341.000
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁷	–	400.000	(57.276)	342.724
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁸	–	1.125.000	(35.994)	1.089.006
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF - USD Distributing ETF ⁸	–	411.000	–	411.000

²Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

³Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

⁴Diese Anteilklasse wurde am 21. Juni 2023 aufgelegt.

⁵Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

⁶Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

⁷Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

⁸Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds und die Anteilklassen wurden am 15. Juni 2023 aufgelegt..

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

6. Grundkapital (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle weist die zahlenmäßige Veränderung bei gewinnberechtigten Anteilen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 detailliert aus:

	Eröffnungs- bestand – am 1. Juli 2021 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurück- genommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2022 aus- gegebene Anteile
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	68.302.602	25.291.055	(64.825.224)	28.768.433
L&G Gold Mining UCITS ETF - USD Accumulating ETF	4.632.093	840.000	(525.000)	4.947.093
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF - USD Distributing ETF	8.345.239	581.460	(2.070.000)	6.856.699
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF - USD Accumulating ETF	48.425.616	4.500.000	(8.200.000)	44.725.616
L&G Cyber Security UCITS ETF - USD Accumulating ETF	109.881.776	31.400.000	(9.025.000)	132.256.776
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF - USD Accumulating ETF	819.278	118.000	(937.278)	–
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF - USD Accumulating ETF	45.450.000	17.700.000	(9.650.000)	53.500.000
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	2.600.000	1.200.000	(700.000)	3.100.000
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF - USD Accumulating ETF	34.232.900	11.050.000	(25.000.000)	20.282.900
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	14.650.000	10.100.000	(800.000)	23.950.000
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF - USD Accumulating ETF	13.583.500	9.000.000	(3.350.000)	19.233.500
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	11.150.000	2.750.000	(3.400.000)	10.500.000
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF – EUR Accumulating ETF ¹	17.965.798	480.000	(10.602.151)	7.843.647
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	114.500.000	3.700.000	(50.564.738)	67.635.262
L&G Clean Energy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	8.600.000	11.000.000	(2.000.000)	17.600.000
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF	6.000.000	1.435.000	(120.000)	7.315.000
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF - GBP Distributing ETF	6.800.000	3.860.000	(600.000)	10.060.000
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF	4.900.000	4.080.000	(509.600)	8.470.400
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF	–	660.000	–	660.000
L&G China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	41.100.000	8.094.570	(31.643.961)	17.550.609
L&G China CNY Bond UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF ²	–	6.896.085	–	6.896.085
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	9.300.000	2.200.000	(800.000)	10.700.000

²Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

6. Grundkapital (Fortsetzung)

Anteilklasse	Eröffnungs- bestand – am 1. Juli 2021 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurück- genommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2022 aus- gegebene Anteile
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF	57.376.000	43.349.059	(66.509.851)	34.215.208
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	50.000	26.701.581	(19.326.632)	7.424.949
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – EUR Hedged Accumulating ETF	–	21.265.157	(676.216)	20.588.941
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Accumulating ETF	–	56.858.261	(12.142.764)	44.715.497
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – GBP Hedged Distributing ETF	–	513.137	–	513.137
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Distributing ETF	–	1.572.550	(103.984)	1.468.566
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	51.900.000	41.650.000	(1.550.000)	92.000.000
L&G ESG Green Bond UCITS ETF - EUR Distributing ETF ³	2.350.000	445.000	(1.834.761)	960.239
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF - EUR Distributing ETF	1.634.080	800.000	(100.000)	2.334.080
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF - USD Distributing ETF	1.900.000	600.000	–	2.500.000
L&G Digital Payments UCITS ETF - USD Accumulating ETF	600.000	1.450.000	–	2.050.000
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF – USD Accumulating ETF	–	63.371.283	(3.350.001)	60.021.282
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF – USD Distributing ETF	–	2.300.000	(400.000)	1.900.000
L&G India INR Government Bond UCITS ETF – USD Distributing ETF	–	30.900.000	(600.000)	30.300.000

³Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

6. Grundkapital (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle zeigt die Geldwerte der Kern- und der abgesicherten Anteilklassen für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022:

	Erlöse aus im Geschäftsjahr ausgegebenen Anteilen in Lokalwährung 30. Juni 2023	Zahlungen für im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile in Lokalwährung 30. Juni 2023	Erlöse aus im Geschäftsjahr ausgegebenen Anteilen in Lokalwährung 30. Juni 2022	Zahlungen für im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile in Lokalwährung 30. Juni 2022
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF	189.249.420 \$	(53.496.974) \$	37.910.719 \$	(4.858.914) \$
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF	48.480.665 €	(1.855.458) €	6.568.170 €	-
L&G China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ¹	32.584.625 \$	(62.434.243) \$	84.655.206 \$	(333.105.269) \$
L&G China CNY Bond UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF ¹	6.361.736 €	(77.854.454) €	71.433.692 €	-
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF	185.370.457 \$	(297.581.066) \$	416.729.223 \$	(656.985.154) \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	14.632.448 \$	(10.053.737) \$	250.852.874 \$	(173.691.286) \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – EUR Hedged Accumulating ETF	66.185.621 €	(78.837.794) €	206.450.865 €	(6.360.465) €
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Accumulating ETF	10.451.355 CHF	(157.138.296) CHF	553.735.428 CHF	(116.582.634) CHF
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – GBP Hedged Distributing ETF	4.483.694 £	(2.387.643) £	5.035.628 £	-
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Distributing ETF	3.739.863 CHF	(3.134.024) CHF	14.853.637 CHF	(979.467) CHF
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF – USD Accumulating ETF	1.038.545.477 \$	(92.661.449) \$	699.252.162 \$	(44.462.073) \$
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF - GBP Accumulating ETF ²	100.000 £	-	n. zutr.	n. zutr.
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF ³	11.353.275 \$	(360.754) \$	n. zutr.	n. zutr.
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF - USD Distributing ETF ³	4.145.239 \$	-	n. zutr.	n. zutr.

¹ Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

² Diese Anteilklasse wurde am 21. Juni 2023 aufgelegt.

³ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Diese Anteilklassen wurden am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

7. Effizientes Portfoliomanagement

Die Gesellschaft kann im Namen jedes Fonds und vorbehaltlich der Bedingungen und innerhalb der von der Zentralbank festgelegten Grenzen Techniken und Instrumente in Bezug auf Wertpapiere zum effizienten Portfoliomanagement einsetzen. Transaktionen für die Zwecke des effizienten Portfoliomanagements können in der Absicht durchgeführt werden, eine Risikominderung, eine Kostenreduzierung oder eine Steigerung des Kapitals oder der Renditen für einen Fonds zu erzielen, dies unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds und der allgemeinen Bestimmungen in den OGAW-Vorschriften.

Diese Techniken und Instrumente können z. B. Anlagen in Pensionsgeschäften, umgekehrten Pensionsgeschäften und Wertpapierleihgeschäften beinhalten. Diese Techniken und Instrumente werden in Einklang mit den Auflagen der Zentralbank eingesetzt. Möglicherweise werden neue Techniken und Instrumente entwickelt, die für den Einsatz durch die Gesellschaft geeignet sind. Die Gesellschaft kann diese neuen Techniken (vorbehaltlich der vorgenannten Beschränkungen) einsetzen. Gemäß den Anforderungen der Zentralbank kann ein Fonds zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements Pensionsgeschäfte bzw. umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen. Die Fonds schließen solche Verträge im Rahmen einer Liquiditätsmanagementstrategie mit der Absicht ab, daraus höhere Renditen als aus Einlagen zu erzielen. Die drei Kontrahenten der Gesellschaft für umgekehrte Pensionsgeschäfte sind Barclays Bank Plc, Citigroup Global Markets Limited und Merrill Lynch International. Der beizulegende Zeitwert von umgekehrten Pensionsgeschäften und Art und Höhe der erhaltenen Sicherheiten sind Anmerkung 5 („Sicherheiten“) zu entnehmen. Für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 gab es keine Transaktionskosten in Verbindung mit dem Kauf- und Verkaufspreis von umgekehrten Pensionsgeschäften.

Näheres zu den Erträgen aus umgekehrten Pensionsgeschäften in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2023 bzw. 30. Juni 2022 ist der Beschreibung „Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung zu entnehmen.

Die Fonds können gegebenenfalls Devisenterminkontrakte abschließen, um eine bestimmte Währung an einem künftigen Termin zu einem bei Abschluss des Kontraktes festgesetzten Kurs zu kaufen oder zu verkaufen. Ein Fonds kann solche Kontrakte abschließen, um sich gegen Wechselkursschwankungen abzusichern. Die Fonds können eine Währung (oder einen Währungskorb) einsetzen, um sich gegen ungünstige Wertschwankungen einer anderen Währung (oder eines Währungskorbs) abzusichern, wenn die Wechselkurse zwischen den beiden Währungen eine positive Korrelation aufweisen.

8. Wesentliche Vereinbarungen und Transaktionen mit verbundenen Parteien

Die Verwaltungsgesellschaft

Die Gesellschaft zahlt aus dem Vermögen der einzelnen Fonds eine Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft, d. h. eine feste Gesamtkostenquote („TER“) auf Basis des Nettoinventarwerts des jeweiligen Fonds, die täglich berechnet wird und monatlich rückwirkend zahlbar ist. Die Verwaltungsgesellschaft, die Abschlussprüfer und die Verwaltungsratsmitglieder sind aus der TER bezahlt worden. Die Gebühr der Verwaltungsgesellschaft ist die Differenz zwischen der TER und anderen zahlbaren Gebühren und Ausgaben. Die jeweiligen TER der Fonds sind auf den Seiten 10 bis 12 aufgeführt. Seit Ablauf des Geschäftsjahrs zum 30. Juni 2023 hat es keine Änderungen an den TERs der Fonds gegeben.

Die Verwaltungsgesellschaft ist dafür verantwortlich, aus der TER die allgemeinen Aufwendungen der Gesellschaft zu begleichen. Das schließt auch die an den Verwalter, die Verwahrstelle, die Abschlussprüfer, den Anlageverwalter, den Unteranlageverwalter, die Registerstelle, den Sponsor, die Vertriebsstelle sowie andere Dienstleister der Gesellschaft zahlbaren Gebühren ein. Aufwendungen, die die TER übersteigen, werden von der Verwaltungsgesellschaft getragen.

Die der Gesellschaft im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 insgesamt angefallenen Verwaltungsgebühren beliefen sich auf 53.383.568 US\$ (30. Juni 2022: 58.784.798 US\$), von denen 4.806.771 US\$ (30. Juni 2022: 4.414.816 US\$) zum 30. Juni 2023 noch ausstanden.

Da es sich bei der Gesellschaft nicht um einen eigenverwalteten OGAW-Fonds handelt, ist die Verwaltungsgesellschaft wie von der Zentralbank vorgeschrieben für die Kapitalverwaltung verantwortlich.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

8. Wesentliche Vereinbarungen und Transaktionen mit verbundenen Parteien (Fortsetzung)

Die Verwaltungsgesellschaft (Fortsetzung)

Die Gesellschaft kann im Rahmen ihrer normalen Geschäftstätigkeit mit LGIM Managers (Europe) Limited und verbundenen Unternehmen Transaktionen nach dem Fremdvergleichsgrundsatz durchführen. Diese Transaktionen mit verbundenen Parteien können den Kauf und Verkauf von Geldmarktfonds beinhalten, die von LGIM Managers (Europe) Limited und ihren verbundenen Unternehmen begeben wurden. Zum 30. Juni 2023 sind die Positionen in den Teilfonds der LGIM Liquidity Funds Plc (LGIM Sterling Liquidity Fund, LGIM US Dollar Liquidity Fund und LGIM Euro Liquidity Fund) in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten erfasst, da die Anteile dieser Fonds jederzeit in bekannte Barbeträge umgewandelt werden können. Der beizulegende Zeitwert der zum Bilanzstichtag in diesen verbundenen Unternehmen gehaltenen Anlagen beläuft sich auf 1.101.324 US\$ (30. Juni 2022: 6.313.169 US\$) und der Betrag der im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 vereinnahmten Erträge auf 155.894 US\$ (30. Juni 2022: 10.492 US\$).

Autorisierte Teilnehmer

Nur autorisierte Teilnehmer sind befugt, Fondsanteile direkt bei der Gesellschaft zu zeichnen und zurückzugeben. Nachstehend folgt eine Liste der autorisierten Teilnehmer zum Bilanzstichtag:

- Barclays Capital Securities Limited
- Citigroup Global Markets Limited
- Credit Suisse Securities (Europe) Limited
- DRW Europe B.V.
- Flow Traders B.V.
- Goldenberg Hehmeyer LLP*
- HSBC Bank Plc
- Jane Street Financial Limited
- Jefferies International Limited
- JP Morgan Securities PLC
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley and Co. International PLC
- Old Mission Europe LLP*
- Optiver VOF
- Société Générale S.A.
- Susquehanna International Securities Limited*
- UBS AG*
- Virtu Financial Ireland Limited

*Neu autorisierte Teilnehmer seit dem 30. Juni 2022.

Beziehungen der Verwaltungsratsmitglieder

Herr Feargal Dempsey, Herr David Fagan und Herr Donard McClean sind ausnahmslos unabhängige nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder und erhielten jeweils Bezüge von 45.000 €, 45.000 € bzw. 40.000 € für der Gesellschaft im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 erbrachte Dienstleistungen (30. Juni 2022: 45.000 €, 45.000 € bzw. 40.000 €).

Herr Howie Li und Frau Patrizia Libotte sind nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft und der Gesellschaft.

Abgesehen von Herrn Feargal Dempsey, Herrn David Fagan und Herrn Donard McClean erhielt keines der anderen Verwaltungsratsmitglieder eine Vergütung für das Amt als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft.

Keines der Verwaltungsratsmitglieder oder der Gesellschaftssekretär, die im Amt waren, hielten zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 noch zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahres Beteiligungen an der Gesellschaft.

Die Zeichneranteile werden von LGIMH und der Verwaltungsgesellschaft gehalten.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

9. Betriebliche Aufwendungen

Gemäß dem Verwahrstellenvertrag zwischen der Gesellschaft, der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle erbringt die Verwahrstelle verschiedene Verwahrdienste und zusätzliche Dienstleistungen für die Gesellschaft. Im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistungen werden verschiedene Gebühren erhoben. Die Gebühren beziehen sich auf Übertragungen, u. a. sowohl Barübertragungen als auch Wertpapierabwicklungen. Zusätzlich zu den sich auf Übertragungen beziehenden Gebühren werden auch Verwahrstellengebühren (als Prozentsatz des verwalteten Vermögens) in Rechnung gestellt. Auch wenn die Verwahrstelle direkt von der Gesellschaft ernannt wurde, so werden ihre Gebühren (mit Ausnahme der Gebühren für Portfoliotransaktionen, die direkt dem entsprechenden Fonds in Rechnung gestellt werden), von der Verwaltungsgesellschaft aus den TER gezahlt, die er von der Gesellschaft erhält.

In Bezug auf die Fonds mit synthetischer Nachbildung ist die Gesellschaft Dreiparteien-Vereinbarungen mit The Bank of New York Mellon (der „Sicherheitenverwalter“) und jeweils Barclays Bank Plc, Citigroup Global Markets Limited bzw. Merrill Lynch International (die „Repo-Kontrahenten“) eingegangen, in deren Rahmen The Bank of New York Mellon als Sicherheitenverwalter in Bezug auf alle Sicherheiten fungiert, die auf die Gesellschaft gemäß den zwischen der Gesellschaft und den Repo-Kontrahenten getätigten umgekehrten Pensionsgeschäften übertragen wurden. Wie es bei Dreiparteien-Vereinbarungen zur Sicherheitenverwaltung üblich ist, zahlt der Empfänger der Sicherheiten (d. h. die Gesellschaft) keine Gebühren in Bezug auf Sicherheitenverwaltungsdienste. Sämtliche damit verbundenen Gebühren werden vom jeweiligen Hinterleger der Sicherheiten (d. h. dem jeweiligen Repo-Kontrahenten) gezahlt.

Die Verwaltungsgesellschaft hat BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company (der „Verwalter“) zum Verwalter und zur Transfer- und Registerstelle der Gesellschaft ernannt und ihr die Verantwortung für die tägliche Verwaltung der Gesellschaft übertragen. Hierzu gehört auch die Berechnung des NIW und des NIW je Anteil für die einzelnen Fonds. Die Gebühr des Verwalters wird von der Verwaltungsgesellschaft aus der TER gezahlt, die sie von der Gesellschaft erhält.

Die Gebühren des Anlageverwalters und des Unteranlageverwalters werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der TER gezahlt, die sie von der Gesellschaft erhält.

Handelsgebühren/Transaktionsgebühren

Seit der Gründung der Gesellschaft wurden die Primärmarkt-Transaktionskosten (im Verkaufsprospekt als „Abgaben und Gebühren“ bezeichnet) für den Handel mit ETFs bei den Berechnungen des Nettoinventarwerts nicht berücksichtigt. Diese Gebühren entsprechen dem autorisierten Teilnehmern zusätzlich zum NIW pro Anteil berechneten Preis bei der Zeichnung oder Rücknahme von Anteilen, um die Kosten zu berücksichtigen, die der Gesellschaft beim Kauf oder bei der Veräußerung von Anteilen aufgrund der jeweiligen Zeichnung/Rücknahme entstehen. Es handelt sich dabei nicht um einen Teil der laufenden Kosten, weshalb sie nicht in den Rechnungsabschluss offengelegt werden.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

10. Vergütung der Abschlussprüfer

Die für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 berechneten Honorare für die Abschlussprüfung werden von der Verwaltungsgesellschaft getragen. Von Ernst & Young wurden als Abschlussprüfer der Gesellschaft für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023 bzw. 30. Juni 2022 keine sonstigen Assurance-Dienstleistungen oder sonstigen prüfungsfremden Leistungen erbracht. In der folgenden Tabelle sind die im jeweiligen Geschäftsjahr berechneten Gebühren ohne MwSt. detailliert aufgeführt.

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 €
Gesetzlich vorgeschriebene Prüfung	292.388	256.385
Sonstige Assurance-Dienstleistungen	-	-
Sonstige prüfungsfremde Leistungen	-	-

11. Swap-Gebühren

Die Swap-Gebühren werden dem Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, belastet und beziehen sich auf die Finanzierungskosten und Gebühren im Zusammenhang mit den Swap-Kontrahenten eingegangenen Swap-Kontrakten. Die Swap-Zinsen richten sich nach dem betreffenden SOFR-/Euribor-/SONIA-Satz, zuzüglich eines Spreads, aus dem die von Swap-Kontrahenten berechneten Gebühren hervorgehen. In der folgenden Tabelle sind die Zinsaufwendungen für Swaps (einschließlich des Spreads) der einzelnen zutreffenden Fonds für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 detailliert aufgeführt.

Fonds	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	(20.830.917) \$	(4.283.875) \$
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	(1.527.291) \$	(291.373) \$
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF ¹	n. zutr.	(3.656) \$
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	(63.744.491) \$	(3.366.652) \$
Gesellschaft insgesamt	(92.326.210) \$	(8.975.116) \$

¹Dieser Fonds wurde am 14. Januar 2022 geschlossen.

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken

1. Risikomanagement

Die Gesellschaft setzt sich durch ihre Tätigkeit verschiedenen finanziellen Risiken aus, wie z. B. dem Marktrisiko (das sich aus dem Preiskrisiko, dem Währungsrisiko und dem Zinsrisiko zusammensetzt), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko, die in dieser Anmerkung erläutert werden.

Das globale Gesamtrisiko wird mittels des Commitment-Ansatzes für Fonds mit physischer Nachbildung und mittels des relativen VaR-Ansatzes für Fonds mit synthetischer Nachbildung berechnet, wie in Anmerkung 12.5 (*Globales Gesamtrisiko*) genauer erörtert.

Die Verwaltungsgesellschaft hat gemäß einem Anlageverwaltungsvertrag die Anlageverwaltungstätigkeiten (d. h. die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte der Gesellschaft) an die Anlageverwalter übertragen. Während der Verwaltungsrat der Gesellschaft letztendlich für die Überwachung der mit der Gesellschaft und ihren Fonds verbundenen Risiken zuständig ist, einschließlich der allgemeinen Überwachung des Anlageperformance-Risikos, wurde das tägliche Management der Anlagerisiken von der Verwaltungsgesellschaft an die Anlageverwalter übertragen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

1. Risikomanagement (Fortsetzung)

Die Anlageverwalter sind gegenüber der Verwaltungsgesellschaft und letztendlich gegenüber dem Verwaltungsrat der Gesellschaft für die Anlageverwaltung der Vermögenswerte der Gesellschaft verantwortlich.

Die Anlagen der Gesellschaft unterliegen gewöhnlichen Marktschwankungen und anderen für Anlagen in Wertpapieren und sonstigen Finanzinstrumenten charakteristischen Risiken. Es kann nicht zugesichert werden, dass Anlagen eine Wertsteigerung erfahren werden, und der Kapitalwert der ursprünglichen Anlage eines Anlegers wird nicht garantiert. Der Wert von Anlagen kann sowohl steigen als auch fallen, und ein Anleger erhält möglicherweise nicht den ursprünglich investierten Betrag zurück.

Die nachstehenden Informationen sollen keinen umfassenden Überblick über alle Risiken im Zusammenhang mit den Anlagen der Gesellschaft darstellen. Anleger sollten für eine detaillierte Zusammenfassung der mit Anlagen in den Fonds der Gesellschaft verbundenen Risiken den Verkaufsprospekt der Gesellschaft und fondsspezifische Nachträge (jeweils im Abschnitt „Risikofaktoren“) zu Rate ziehen.

Neben der Identifizierung von Risiken bei der Planung der Auflegung neuer Fonds überprüft die Verwaltungsgesellschaft auf vierteljährlicher Basis die Anlageverwaltung und den Betrieb der Fonds sowie eine Liste der finanziellen Kontrahenten und autorisierten Teilnehmer. Darüber hinaus erhält der Verwaltungsrat regelmäßige Compliance- und Risikoberichte von den Anlageverwaltern, die Probleme mit wesentlichen Risiken identifizieren sollen. Der Verwaltungsrat kann zusätzlich Informationen von anderen Parteien einholen, wie z. B. dem Geldwäschebeauftragten (Money Laundering Reporting Officer – MLRO), der Verwaltungsgesellschaft, dem Verwalter oder der Verwahrstelle.

Die Verwaltungsgesellschaft hat für das Geschäft der Gesellschaft einen ausführlichen Geschäftsplan implementiert, in dem die wesentlichen Risiken in Verbindung mit der Führung der Gesellschaft und die Methoden zur Überwachung und Messung dieser Risiken aufgeführt sind. Im Verkaufsprospekt der Gesellschaft sind die Risiken im Zusammenhang mit dem Management der Fonds sowie einer Anlage in die Fonds im Einzelnen dargelegt.

Kapitalrisikomanagement

Das Kapital der Fonds wird durch das Nettovermögen am Ende des aktuellen und der vorherigen Geschäftsjahre repräsentiert. Die Höhe des Nettovermögens kann sich täglich erheblich ändern, da die Fonds täglichen Zeichnungen und Rücknahmen nach Ermessen der Anteilhaber ausgesetzt sind. Zur Wahrung der Fähigkeit der Fonds, ihre Geschäfte fortzuführen und eine starke Kapitalbasis zu behalten, werden rückkaufbare, gewinnberechtigende Anteile gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft und den fondsspezifischen Nachträgen ausgegeben und zurückgenommen, welche die Fähigkeit einschließen, Rücknahmebeschränkungen aufzuerlegen und bestimmte Mindestbestände und Mindestzeichnungen zu verlangen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung

A. Marktrisiko

Das Marktrisiko ist das Risiko, dass der Wert von gehaltenen Instrumenten aufgrund von Veränderungen der Marktpreise, die durch das Preisrisiko, das Währungsrisiko und das Zinsrisiko bedingt sind, schwankt.

(i) Preisrisiko

Das Preisrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder künftige Cashflows eines Finanzinstrumentes aufgrund von Veränderungen der Marktpreise (außer solchen, die sich aus Zins- oder Währungsrisiken ergeben) schwanken, wobei diese Veränderungen durch spezifische Faktoren des einzelnen Finanzinstrumentes oder seines Emittenten bedingt sein können oder durch Faktoren, welche ähnliche am Markt gehandelte Instrumente beeinflussen.

Mehrere Fonds der Gesellschaft sind „thematische“, sektorspezifische oder länderspezifische Fonds oder Fonds, die sich auf einen einzelnen Rohstoff oder eine einzelne Rohstoffbranche konzentrieren. Rohstoffpreise sind beeinflusst von Faktoren wie zum Beispiel Angebots- und Nachfrageveränderungen auf den Rohstoffmärkten, technologischen Veränderungen, die sich auf das Produktionsniveau bei Rohstoffen auswirken können, Handelsprotektionismus oder Marktliberalisierungen, Umweltveränderungen, Agrar-, Steuer-, geldpolitischen und Devisenkontrollprogrammen und politischen Entscheidungen von Regierungen (einschließlich der staatlichen Intervention in bestimmten Märkten).

Eine 5 %-ige Veränderung im Wert der von den folgenden Fonds gehaltenen Wertpapiere würde zu einer Veränderung des Nettovermögens in Höhe der folgenden Beträge führen. Die geografischen Konzentrationen von Wertpapieren, die von den Fonds mit physischer Nachbildung gehalten werden, sind der Aufstellung der Vermögenswerte zu entnehmen.

	30. Juni 2023	30. Juni 2022
L&G Gold Mining UCITS ETF	6.496.171 \$	6.338.141 \$
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	52.113.684 \$	40.078.329 \$
L&G Cyber Security UCITS ETF	125.985.313 \$	123.380.796 \$
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	52.061.336 \$	38.619.350 \$
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	2.321.160 \$	1.694.765 \$
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	12.705.826 \$	13.123.598 \$
L&G Clean Water UCITS ETF	22.154.339 \$	15.385.108 \$
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	20.522.703 \$	11.160.091 \$
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	6.165.953 \$	6.251.499 \$
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹	19.719.501 €	4.597.297 €
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹	67.690.589 \$	42.943.936 \$

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(i) Preisrisiko (Fortsetzung)

	30. Juni 2023	30. Juni 2022
L&G Clean Energy UCITS ETF	10.661.060 \$	8.758.632 \$
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	4.674.617 £	3.412.956 £
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	5.239.040 £	4.146.201 £
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	13.309.960 \$	3.916.742 \$
L&G China CNY Bond UCITS ETF ²	6.820.833 \$	12.753.477 \$
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	6.043.590 \$	4.507.207 \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	34.780.207 \$	47.542.801 \$
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	26.597.928 \$	24.759.700 \$
L&G ESG Green Bond UCITS ETF ³	n. zutr.	405.702 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	1.454.747 €	1.061.782 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	1.061.952 \$	1.049.007 \$
L&G Digital Payments UCITS ETF	1.159.343 \$	576.944 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	880.316 \$	781.201 \$
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	19.053.347 \$	13.840.719 \$
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF ⁴	184.200 \$	n. zutr.
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF ⁵	189.728 \$	n. zutr.
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ⁵	130.563 \$	n. zutr.
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ⁵	389.814 \$	n. zutr.
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ⁶	193.021 \$	n. zutr.
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ⁶	208.322 \$	n. zutr.
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF ⁷	758.288 \$	n. zutr.

¹ Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

² Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

³ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

⁴ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

⁵ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

⁶ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Diese Anteilklassen wurden am 15. Juni 2023 aufgelegt.

(ii) Währungsrisiko

Das Währungsrisiko ist das Risiko, dass der Wert des auf die Funktionalwährung eines Fonds lautenden Nettovermögens eines Fonds aufgrund von Wechselkursveränderungen schwankt.

Die Fonds mit physischer Nachbildung halten auf andere Währungen als die Funktionalwährung des Fonds lautende Vermögenswerte. Sie können daher Wechselkursrisiken ausgesetzt sein, da der Wert der auf andere Währungen lautenden Wertpapiere aufgrund der Veränderungen von Wechselkursen schwankt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Die nachstehenden Tabellen weisen das Währungsrisiko der Fonds mit physischer Nachbildung (mit Ausnahme des des L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF, des L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF, des L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF und des L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF, für die kein Währungsrisiko besteht) zum 30. Juni 2023 aus:

30. Juni 2023 L&G Gold Mining UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	28.886.171	-	-	28.886.171
Kanadischer Dollar	51.360.521	937	1.806	51.363.264
Britisches Pfund	1.091.101	89	-	1.091.190
Südafrikanischer Rand	23.413.990	-	-	23.413.990
	104.751.783	1.026	1.806	104.754.615

30. Juni 2023 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Kanadischer Dollar	15.197.668	367	-	15.198.035
Chinesischer Yuan Renminbi	11.894.650	-	-	11.894.650
Euro	110.492.916	8.151	-	110.501.067
Japanischer Yen	211.063.441	579.621	503.451	212.146.513
Koreanischer Won	10.609.047	-	-	10.609.047
Norwegische Krone	13.998.550	1.800	-	14.000.350
Britisches Pfund	33.152.015	3.849	-	33.155.864
Schwedische Krone	26.862.344	1.543	-	26.863.887
Schweizer Franken	44.796.648	4.489	-	44.801.137
Taiwanesischer Dollar	64.322.158	85.001	7.806	64.414.965
	542.389.437	684.821	511.257	543.585.515

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023 L&G Cyber Security UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	
Kanadischer Dollar	123.122.168	1.399.252	(1.313.549)	123.207.871
Euro	22.041.708	60	1.462	22.043.230
Japanischer Yen	128.025.995	156.880	(156.880)	128.025.995
Koreanischer Won	23.441.477	-	-	23.441.477
Britisches Pfund	140.751.807	(873)	(9.542)	140.741.392
	437.383.155	1.555.319	(2.792.058)	437.459.965

30. Juni 2023 L&G Battery Value-Chain UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	
Australischer Dollar	137.148.403	-	-	137.148.403
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	164.159	164.159
Euro	226.807.983	2.991	-	226.810.974
Hongkong Dollar	41.139.445	-	-	41.139.445
Japanischer Yen	228.025.967	-	-	228.025.967
Koreanischer Won	107.447.136	-	-	107.447.136
Schweizer Franken	38.565.540	128	-	38.565.668
Taiwanesischer Dollar	39.382.362	-	888.658	40.271.020
	818.516.836	3.119	1.052.817	819.572.772

30. Juni 2023 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Netto- vermögen/(- verbindlichkeiten) US\$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	
Australischer Dollar	1.441.101	-	-	1.441.101
Dänische Krone	1.696.217	1.935	-	1.698.152
Euro	1.690.058	7.199	-	1.697.257
Hongkong Dollar	2.801.732	-	-	2.801.732
Japanischer Yen	8.111.633	-	27.766	8.139.399
Schwedische Krone	1.383.148	3.454	-	1.386.602
Schweizer Franken	-	(1)	-	(1)
	17.123.889	12.587	27.766	17.164.242

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	
Kanadischer Dollar	16.868.743	61	-	16.868.804
Dänische Krone	19.786.152	110	-	19.786.262
Euro	21.872.192	96	-	21.872.288
Hongkong Dollar	9.812.021	129.105	-	9.941.126
Japanischer Yen	21.565.735	66.155	106.315	21.738.205
Koreanischer Won	6.207.786	-	-	6.207.786
Neuseeland-Dollar	7.151.428	-	-	7.151.428
Britisches Pfund	14.374.173	293	-	14.374.466
Singapur-Dollar	6.406.259	-	-	6.406.259
Schweizer Franken	7.140.311	7	-	7.140.318
Taiwanesischer Dollar	2.473.953	-	-	2.473.953
	133.658.753	195.827	106.315	133.960.895

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023 L&G Clean Water UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettvermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettvermögen \$
Euro	33.855.048	1.450	195.286	34.051.784
Hongkong Dollar	14.608.604	-	-	14.608.604
Japanischer Yen	30.316.107	-	38.825	30.354.932
Britisches Pfund	39.663.445	1.894	537.791	40.203.130
Schweizer Franken	15.448.584	729	-	15.449.313
	133.891.788	4.073	771.902	134.667.763

30. Juni 2023 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettvermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettvermögen \$
Chinesischer Yuan Renminbi	1.613.320	(4)	-	1.613.316
Euro	10.829.324	403	-	10.829.727
Hongkong Dollar	-	-	-	-
Britisches Pfund	5.489.292	301	-	5.489.593
Taiwanesischer Dollar	18.820.011	50.996	469.722	19.340.729
	36.751.947	51.696	469.722	37.273.365

30. Juni 2023 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettvermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettvermögen \$
Australischer Dollar	-	1	-	1
Euro	7.829.604	-	-	7.829.604
Hongkong Dollar	1.573.005	-	-	1.573.005
Japanischer Yen	1.217.522	5.110	-	1.222.632
Britisches Pfund	1.530.098	-	-	1.530.098
Schweizer Franken	5.035.617	1.852	-	5.037.469
	17.185.846	6.963	-	17.192.809

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023 LL&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten €	Summe Nettovermögen €
Dänische Krone	21.336.887	7.321	-	21.344.208
Norwegische Krone	2.389.635	5.625	-	2.395.260
Polnischer Zloty	1.617.118	333	-	1.617.451
Britisches Pfund	77.338.188	26.133	141.044	77.505.365
Schwedische Krone	18.734.400	14.065	677	18.749.142
Schweizer Franken	67.988.541	5.464	-	67.994.005
US-Dollar	-	1.661	15.226	16.887
	189.404.769	60.602	156.947	189.622.318

30. Juni 2023 L&G Clean Energy UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	5.499.924	-	-	5.499.924
Kanadischer Dollar	10.083.633	48	14.302	10.097.983
Dänische Krone	10.828.822	1.917	-	10.830.739
Euro	96.457.905	7.673	-	96.465.578
Japanischer Yen	28.232.121	180.815	-	28.412.936
Norwegische Krone	4.860.677	406	-	4.861.083
Britisches Pfund	-	1	-	1
	155.963.082	190.860	14.302	156.168.244

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023 L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen £	Festverzinslich Anlagen £	Termin-geschäfte £	Zahlungsmittel £	Sonstige Netto-vermögenswerte/(-verbind-lichkeiten) £	Summe Netto-vermögen £
Euro	-	-	-	341	-	341
	-	-	-	341	-	341

30. Juni 2023 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheine n £	Festverzinslich Anlagen £	Termin-geschäfte £	Zahlungsmittel £	Sonstige Netto-vermögenswerte/(-verbind-lichkeiten) £	Summe Netto-vermögen £
Euro	-	-	-	367	-	367
	-	-	-	367	-	367

30. Juni 2023 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheine n US\$	Festverzinslich Anlagen \$	Termin-geschäfte \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto-vermögenswerte/(-verbind-lichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Euro	-	-	58.303.923	3.022	-	58.306.945
	-	-	58.303.923	3.022	-	58.306.945

30. Juni 2023 L&G China CNY Bond UCITS ET _F ¹	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinslich Anlagen \$	Termin-geschäfte \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto-vermögenswerte/(-verbind-lichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Chinesischer Yuan Renminbi	-	136.416.652	-	150.926	1.590.028	138.157.606
Euro	-	-	-	934	-	934
	-	136.416.652	-	151.860	1.590.028	138.158.540

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

30. Juni 2023 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinslich Anlagen \$	Termin-geschäfte \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto-vermögenswerte/(-verbind-lichkeiten) \$	Summe Netto-vermögen \$
Euro	-	-	177.538.757	8.113	-	177.546.870
Britisches Pfund	-	-	8.200.069	9.063	-	8.209.132
Schweizer Franken	-	-	273.205.684	790	-	273.206.474
	-	-	458.944.510	17.966	-	458.962.476

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Kanadischer Dollar	-	1	-	1
Dänische Krone	26.412.924	577	-	26.413.501
Euro	53.647.712	1.226	-	53.648.938
Hongkong Dollar	24.907.675	-	-	24.907.675
Japanischer Yen	85.168.052	459.382	-	85.627.434
Koreanischer Won	63.013.787	-	100.340	63.114.127
Norwegische Krone	18.028.840	649	-	18.029.489
Britisches Pfund	33.895.766	1.131	709.092	34.605.989
Schwedische Krone	6.670.809	99	-	6.670.908
	311.745.565	463.065	809.432	313.018.062

30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) €	
Dänische Krone	877.862	282	-	878.144
Norwegische Krone	2.112.052	699	-	2.112.751
Polnischer Zloty	496.938	2.811	2.125	501.874
Schwedische Krone	2.236.895	361	-	2.237.256
Schweizer Franken	3.450.855	167	-	3.451.022
	9.174.602	4.320	2.125	9.181.047

30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	6.808.202	-	26.189	6.834.391
Hongkong Dollar	3.773.492	-	10.230	3.783.722
Koreanischer Won	6.484.957	1	25.032	6.509.990
Neuseeland-Dollar	2.077.880	-	841	2.078.721
Singapur-Dollar	2.094.500	-	-	2.094.500
	21.239.031	1	62.292	21.301.324

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(li) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023 L&G Digital Payments UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Anlagen \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	163.917	-	-	163.917
Kanadischer Dollar	1.286.528	-	-	1.286.528
Euro	2.236.180	3.148	-	2.239.328
Hongkong Dollar	490.823	-	-	490.823
Japanischer Yen	1.185.281	17.073	-	1.202.354
Koreanischer Won	473.692	-	-	473.692
Britisches Pfund	1.299.082	-	-	1.299.082
	7.135.503	20.221	-	7.155.724

30. Juni 2023 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF Funktionalwährung	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen
				\$
Brasilianischer Real	1.511.288	5.371	10.822	1.527.481
Chinesischer Yuan Renminbi	1.445.742	21.329	45.288	1.512.359
Chilenischer Peso	506.056	-	-	506.056
Kolumbianischer Peso	216.846	-	2.785	219.631
Tschechische Krone	19.195	978	-	20.173
Ägyptisches Pfund	80.617	478	-	81.095
Euro	84.541	-	3.966	88.507
Hongkong Dollar	3.618.460	15.432	26.818	3.660.710
Ungarischer Forint	61.763	-	-	61.763
Indische Rupie	1.158.988	-	4.405	1.163.393
Indonesische Rupiah	446.080	-	1.798	447.878
Malaysischer Ringgit	448.568	-	-	448.568
Mexikanischer Peso	519.707	-	-	519.707
Pakistanische Rupie	23.618	-	-	23.618
Philippinischer Peso	129.216	-	-	129.216
Katar-Riyal	174.308	(9)	-	174.299
Neuer rumänischer Leu	42.720	2.953	-	45.673
Russischer Rubel	-	3.489	-	3.489
Saudi Riyal	372.759	11	-	372.770
Südafrikanischer Rand	411.997	1.277	764	414.038
Taiwanesischer Dollar	4.854.098	4.133	46.534	4.904.765
Thailändischer Baht	646.758	(530)	-	646.228
Türkischer Yeni	440.031	-	-	440.031
VAE-Dirham	352.098	-	-	352.098
	17.565.454	54.912	143.180	17.763.546

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023 L&G India INR Government Bond UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinslich Anlagen \$	Barmittel US\$	Sonstige Nettovermögenswerte /(-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Indische Rupie	-	381.066.938	146.254	5.802.988	387.016.180
	-	381.066.938	146.254	5.802.988	387.016.180

30. Juni 2023 L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions ¹ Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen US\$	Barmittel US\$	Sonstige Nettovermögenswerte /(-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Euro	569.705	-	495	570.200
Hongkong Dollar	74.015	406	-	74.421
Japanischer Yen	1.000.330	3.327	(2.169)	1.001.488
Britisches Pfund	107.749	(46)	281	107.984
Schwedische Krone	109.566	25	50	109.641
Schweizer Franken	165.038	23	133	165.194
	2.026.403	3.735	(1.210)	2.028.928

¹Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

30. Juni 2023 L&G Global Thematic ESG Exclusions ² Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen US\$	Barmittel US\$	Sonstige Nettovermögenswerte /(-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	83.441	-	-	83.441
Kanadischer Dollar	63.352	48	-	63.400
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	89	89
Dänische Krone	73.100	105	-	73.205
Euro	478.740	47	223	479.010
Hongkong Dollar	81.909	379	-	82.288
Japanischer Yen	461.312	1.419	668	463.399
Koreanischer Won	80.769	-	-	80.769
Neuseeland-Dollar	9.837	-	-	9.837
Norwegische Krone	16.515	4	-	16.519
Britisches Pfund	83.320	-	619	83.939
Schwedische Krone	24.680	69	-	24.749
Schweizer Franken	48.791	6	-	48.797
Taiwanesischer Dollar	85.545	51	1.068	86.664
	1.591.311	2.128	2.667	1.596.106

¹Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

²Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(li) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023		Fremdwährungsrisiko		
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ¹ Funktionalwährung	Anlagen US\$	Barmittel US\$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Euro	83.526	-	-	83.526
Hongkong Dollar	10.670	-	-	10.670
Japanischer Yen	10.520	53	-	10.573
Koreanischer Won	155.277	-	468	155.745
Norwegische Krone	3.044	-	-	3.044
Schwedische Krone	59.051	104	-	59.155
Taiwanesischer Dollar	164.891	-	4.910	169.801
	486.979	157	5.378	492.514

¹ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

30. Juni 2023		Fremdwährungsrisiko		
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ² Funktionalwährung	Anlagen US\$	Barmittel US\$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Euro	372.267	43	-	372.310
Japanischer Yen	504.608	-	-	504.608
Britisches Pfund	361.488	(5)	2.049	363.532
Taiwanesischer Dollar	392.022	-	1.694	393.716
	1.630.385	38	3.743	1.634.166

² Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

30. Juni 2023		Fremdwährungsrisiko		
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF Funktionalwährung	Anlagen US\$	Barmittel US\$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	2.324.105	2.662	14.778	2.341.545
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	23	23
Hongkong Dollar	831.616	1.490	3.382	836.488
Neuseeland-Dollar	262.273	-	484	262.757
Singapur-Dollar	393.837	205	60	394.102
	3.811.831	4.357	18.727	3.834.915

³ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

30. Juni 2023		Fremdwährungsrisiko		
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ⁴ Funktionalwährung	Anlagen US\$	Barmittel US\$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Japanischer Yen	4.166.432	8.579	2.861	4.177.872
	4.166.432	8.579	2.861	4.177.872

⁴ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(li) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2023 L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen US\$	Barmittel US\$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	338.963	-	90	339.053
Brasilianischer Real	206.445	-	472	206.917
Kanadischer Dollar	450.412	86	731	451.229
Chinesischer Yuan Renminbi	131.466	491	665	132.622
Chilenischer Peso	6.482	-	-	6.482
Kolumbianischer Peso	9.002	-	96	9.098
Tschechische Krone	9.532	31	-	9.563
Dänische Krone	178.692	-	-	178.692
Ägyptisches Pfund	3.857	-	-	3.857
Euro	1.883.013	825	1.394	1.885.232
Hongkong Dollar	587.904	-	808	588.712
Ungarischer Forint	13.599	-	-	13.599
Indonesische Rupiah	84.660	-	79	84.739
Israelischer Schekel	53.921	825	-	54.746
Japanischer Yen	854.407	-	1.015	855.422
Koreanischer Won	307.590	-	835	308.425
Kuwaitischer Dinar	29.356	-	-	29.356
Malaysischer Ringgit	37.092	-	-	37.092
Mexikanischer Peso	100.483	-	-	100.483
Neuseeland-Dollar	35.944	(5)	33	35.972
Norwegische Krone	69.885	-	-	69.885
Philippinischer Peso	20.542	-	-	20.542
Polnischer Zloty	83.487	206	-	83.693
Britisches Pfund	642.708	36	831	643.575
Katar-Riyal	46.119	-	-	46.119
Saudi Riyal	234.475	-	-	234.475
Singapur-Dollar	155.681	-	-	155.681
Südafrikanischer Rand	80.563	-	-	80.563
Schwedische Krone	189.010	84	-	189.094
Schweizer Franken	309.665	-	-	309.665
Taiwanesischer Dollar	281.178	-	3.507	284.685
Thailändischer Baht	54.827	-	-	54.827
Türkischer Yeni	42.662	-	-	42.662
VAE-Dirham	129.276	-	-	129.276
	7.662.898	2.579	10.556	7.676.033

¹ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Die nachstehenden Tabellen weisen detailliert das Währungsrisiko der Fonds mit physischer Nachbildung (mit Ausnahme des L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF, des L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF, des L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF, des L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF und des L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF, für die kein Währungsrisiko besteht) zum 30. Juni 2022 aus:

	Fremdwährungsrisiko			

30. Juni 2022 L&G Gold Mining UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettvermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	22.015.289	–	–	22.015.289
Kanadischer Dollar	59.390.315	62.905	1.852	59.455.072
Britisches Pfund	3.851.153	–	–	3.851.153
Südafrikanischer Rand	20.023.942	979	76.445	20.101.366
	105.280.699	63.884	78.297	105.422.880

30. Juni 2022 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettvermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Kanadischer Dollar	11.585.728	–	–	11.585.728
Chinesischer Yuan Renminbi	12.567.329	18.129	–	12.585.458
Euro	76.140.926	5.796	–	76.146.722
Japanischer Yen	178.954.050	398.932	445.831	179.798.813
Koreanischer Won	9.018.798	–	–	9.018.798
Norwegische Krone	6.779.374	322	–	6.779.696
Britisches Pfund	19.319.328	1.139	–	19.320.467
Schwedische Krone	18.783.483	1.900	–	18.785.383
Schweizer Franken	35.178.013	3.242	–	35.181.255
Taiwanesischer Dollar	52.142.367	100.772	165.751	52.408.890
	420.469.396	530.232	611.582	421.611.210

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2022 L&G Cyber Security UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettvermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettvermögen \$
Kanadischer Dollar	116.237.553	3.682	–	116.241.235
Euro	14.943.433	140	–	14.943.573
Japanischer Yen	134.740.512	–	–	134.740.512
Koreanischer Won	32.655.392	–	–	32.655.392
Britisches Pfund	106.450.373	4.379	–	106.454.752
Schwedische Krone	14.776.441	742	–	14.777.183
	419.803.704	8.943	–	419.812.647

30. Juni 2022 L&G Battery Value–Chain UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettvermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettvermögen \$
Australischer Dollar	82.029.371	–	–	82.029.371
Kanadischer Dollar	2.333.444	1.004	(1.007)	2.333.441
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	16.746	16.746
Euro	159.582.212	(13.565)	12.102	159.580.749
Hongkong Dollar	45.628.185	–	(14)	45.628.171
Japanischer Yen	172.344.930	–	–	172.344.930
Koreanischer Won	68.197.816	–	–	68.197.816
Schweizer Franken	30.340.779	11.559	(11.078)	30.341.260
Taiwanesischer Dollar	60.415.489	146.382	616.742	61.178.613
	620.872.226	145.380	633.491	621.651.097

30. Juni 2022 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettvermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettvermögen \$
Australischer Dollar	1.536.386	–	–	1.536.386
Dänische Krone	1.111.471	422	–	1.111.893
Euro	3.361.837	1.203	–	3.363.040
Hongkong Dollar	1.152.728	–	9.568	1.162.296
Japanischer Yen	2.843.387	6.091	14.682	2.864.160
Britisches Pfund	459.178	371	–	459.549
Schwedische Krone	1.249.828	818	–	1.250.646
Schweizer Franken	982.256	394	–	982.650
	12.697.071	9.299	24.250	12.730.620

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2022 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	
Kanadischer Dollar	10.009.684	–	–	10.009.684
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	252.005	252.005
Dänische Krone	15.130.695	–	–	15.130.695
Euro	38.019.331	769	–	38.020.100
Hongkong Dollar	15.785.213	–	–	15.785.213
Japanischer Yen	49.235.867	107.790	179.596	49.523.253
Koreanischer Won	6.493.627	–	–	6.493.627
Neuseeland-Dollar	5.819.052	–	–	5.819.052
Britisches Pfund	4.720.331	(1.195.278)	–	3.525.053
Schweizer Franken	6.424.148	108	–	6.424.256
Taiwanesischer Dollar	4.935.162	–	569.465	5.504.627
	156.573.110	(1.086.611)	1.001.066	156.487.565

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2022 L&G Clean Water UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	
Euro	26.102.383	(3.696)	2.041	26.100.728
Hongkong Dollar	23.024.802	141.956	27.966	23.194.724
Japanischer Yen	17.348.544	83.795	(47.783)	17.384.556
Britisches Pfund	27.285.481	(2.753)	296.071	27.578.799
Schwedische Krone	5.422.223	(1.448)	1.355	5.422.130
Schweizer Franken	10.837.573	(577)	556	10.837.552
	110.021.006	217.277	280.206	110.518.489

30. Juni 2022 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	
Australischer Dollar	2.449.741	–	–	2.449.741
Chinesischer Yuan Renminbi	891.192	(7.910)	–	883.282
Euro	5.630.851	324	–	5.631.175
Hongkong Dollar	5.996.440	–	–	5.996.440
Polnischer Zloty	1.994.569	60	–	1.994.629
Britisches Pfund	2.375.882	200	–	2.376.082
Taiwanesischer Dollar	8.529.331	28.010	253.815	8.811.156
	27.868.006	20.684	253.815	28.142.505

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2022 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	1.449.470	–	–	1.449.470
Dänische Krone	1.076.844	1.947	–	1.078.791
Euro	7.840.836	–	–	7.840.836
Hongkong Dollar	1.948.892	–	–	1.948.892
Japanischer Yen	995.227	3.984	–	999.211
Britisches Pfund	2.676.115	–	–	2.676.115
Schweizer Franken	4.870.736	6.362	–	4.877.098
	20.858.120	12.293	–	20.870.413

30. Juni 2022 L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten €	Summe Nettovermögen €
Dänische Krone	4.255.691	–	–	4.255.691
Norwegische Krone	815.742	1.152	–	816.894
Polnischer Zloty	291.770	–	443	292.213
Britisches Pfund	20.124.156	12.262	67.102	20.203.520
Schwedische Krone	4.681.335	202	1.362	4.682.899
Schweizer Franken	16.936.769	1.774	160	16.938.703
US-Dollar	–	6.424	4.169	10.593
	47.105.463	21.814	73.236	47.200.513

30. Juni 2022 L&G Clean Energy UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	6.295.487	–	–	6.295.487
Kanadischer Dollar	11.935.980	–	12.202	11.948.182
Dänische Krone	5.136.587	59	–	5.136.646
Euro	55.457.648	4.826.314	–	60.283.962
Japanischer Yen	22.079.144	–	–	22.079.144
Koreanischer Won	8.198.699	–	–	8.198.699
Norwegische Krone	7.874.354	374	–	7.874.728
Britisches Pfund	3.155.830	(966)	–	3.154.864
Schwedische Krone	4.660.286	423	–	4.660.709
Taiwanesischer Dollar	7.960.555	–	50.466	8.011.021
	132.754.570	4.826.204	62.668	137.643.442

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2022 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinslich Anlagen \$	Termin- geschäfte \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Netto- vermögen \$
Euro	–	–	6.774.306	(123)	–	6.774.183
	–	–	6.774.306	(123)	–	6.774.183

30. Juni 2022 L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinslich Anlagen \$	Termin- geschäfte \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen/(- verbindlichkeiten) \$
Chinesischer Yuan Renminbi	–	255.069.539	–	102.743	3.441.782	258.614.064
Euro	–	–	–	(53.929)	–	(53.929)
	–	255.069.539	–	48.814	3.441.782	258.560.135

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

30. Juni 2022 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinslich Anlagen \$	Termin- geschäfte \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Netto- vermögen \$
Euro	–	–	182.987.364	5.820	–	182.993.184
Britisches Pfund	–	–	5.414.761	8.630	–	5.423.391
Schweizer Franken	–	–	410.968.912	2.145	–	410.971.057
	–	–	599.371.037	16.595	–	599.387.632

30. Juni 2022 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Kanadischer Dollar	971.336	249	–	971.585
Dänische Krone	22.071.320	2	–	22.071.322
Euro	82.164.996	707	–	82.165.703
Hongkong Dollar	26.557.492	–	–	26.557.492
Japanischer Yen	61.064.539	–	–	61.064.539
Koreanischer Won	54.533.420	503.274	92.667	55.129.361
Norwegische Krone	19.469.470	2.183	–	19.471.653
Britisches Pfund	50.692.062	5.426	512.304	51.209.792
Schwedische Krone	16.740.574	1.986	–	16.742.560
	334.265.209	513.827	604.971	335.384.007

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2022 L&G ESG Green Bond UCITS ETF ¹ Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Festverzinslich Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Nettovermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) €	
Britisches Pfund	97.347	383.823	848	20.783	502.801
US-Dollar	138.924	1.653.379	1.934	53.791	1.848.028
	236.271	2.037.202	2.782	74.574	2.350.829

¹Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Nettovermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) €		
Dänische Krone	462.704	1.371	–	–	464.075
Norwegische Krone	1.697.747	2.380	–	–	1.700.127
Polnischer Zloty	291.948	–	–	–	291.948
Schwedische Krone	1.812.487	–	–	–	1.812.487
Schweizer Franken	2.805.479	331	–	–	2.805.810
	7.070.365	4.082	–	–	7.074.447

30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$		
Australischer Dollar	6.431.679	42	21.220	–	6.452.941
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	4.470	–	4.470
Hongkong Dollar	5.167.898	–	29.485	–	5.197.383
Koreanischer Won	5.679.476	944	13.274	–	5.693.694
Neuseeland-Dollar	1.901.547	–	998	–	1.902.545
Singapur-Dollar	1.799.539	–	–	–	1.799.539
	20.980.139	986	69.447	–	21.050.572

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2022 L&G Digital Payments UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	236.236	–	–	236.236
Kanadischer Dollar	529.395	11.043	–	540.438
Euro	1.063.572	2.717	–	1.066.289
Hongkong Dollar	615.084	–	–	615.084
Japanischer Yen	522.852	–	–	522.852
Neuseeland-Dollar	247.585	–	–	247.585
Britisches Pfund	474.183	–	–	474.183
	3.688.907	13.760	–	3.702.667

30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Brasilianischer Real	1.122.628	6.333	4.199	1.133.160
Chinesischer Yuan Renminbi	1.387.160	23.833	68.407	1.479.400
Chilenischer Peso	238.204	(2.267)	–	235.937
Kolumbianischer Peso	106.319	–	–	106.319
Tschechische Krone	17.202	1.177	–	18.379
Ägyptisches Pfund	92.727	(2)	–	92.725
Euro	14.218	90	193	14.501
Hongkong Dollar	3.621.055	6.614	27.370	3.655.039
Ungarischer Forint	77.559	879	–	78.438
Indische Rupie	860.228	–	5.846	866.074
Indonesische Rupiah	329.574	1.814	1.103	332.491
Kuwaitischer Dinar	62.358	–	–	62.358
Malaysischer Ringgit	448.999	–	–	448.999
Mexikanischer Peso	422.594	–	–	422.594
Pakistanische Rupie	68.143	124	–	68.267
Philippinischer Peso	91.079	–	–	91.079
Katar-Riyal	187.400	–	–	187.400
Russischer Rubel	–	10.496	–	10.496
Saudi Riyal	362.154	2.283	–	364.437
Südafrikanischer Rand	495.020	3.764	2.764	501.548
Taiwanesischer Dollar	4.094.274	–	41.420	4.135.694
Thailändischer Baht	663.119	–	–	663.119
Türkische Lira	456.739	2.233	–	458.972
VAE-Dirham	338.277	–	–	338.277
	15.557.030	57.371	151.302	15.765.703

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2022 L&G India INR Government Bond UCITS ETF Funktionalwährung	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinslich Anlagen \$	Fremdwährungsrisiko		Summe Nettovermögen \$
			Barmittel US\$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Indische Rupie	-	276.814.385	40.476	2.541.026	279.395.887
	-	276.814.385	40.476	2.541.026	279.395.887

Eine 5 %-ige Veränderung der Wechselkurse würde zu einer Veränderung der Anlagen der folgenden Fonds um den folgenden Betrag führen.

	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % steigt 30. Juni 2023	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % fällt 30. Juni 2023	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % steigt 30. Juni 2022	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % fällt 30. Juni 2022
L&G Gold Mining UCITS ETF	(4.988.180) \$	5.513.252 \$	(5.013.367) \$	5.541.090 \$
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	(25.828.068) \$	28.546.812 \$	(20.022.352) \$	22.129.968 \$
L&G Cyber Security UCITS ETF	(20.827.769) \$	23.020.166 \$	(19.990.654) \$	22.094.934 \$
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	(38.976.992) \$	43.079.833 \$	(29.565.344) \$	32.677.486 \$
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	(815.423) \$	901.257 \$	(604.622) \$	668.267 \$
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	(6.364.702) \$	7.034.671 \$	(7.455.863) \$	8.240.690 \$
L&G Clean Water UCITS ETF	(6.375.799) \$	7.046.936 \$	(5.239.096) \$	5.790.579 \$
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	(1.750.093) \$	1.934.313 \$	(1.327.048) \$	1.466.737 \$
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	(818.374) \$	904.518 \$	(993.244) \$	1.097.796 \$
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹	(9.019.275) €	9.968.672 €	(2.243.117) €	2.479.235 €
L&G Clean Energy UCITS ETF	(7.426.813) \$	8.208.583 \$	(6.321.646) \$	6.987.083 \$
L&G China CNY Bond UCITS ETF ²	(6.496.031) \$	7.179.824 \$	(12.146.169) \$	13.424.713 \$
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	(14.845.027) \$	16.407.661 \$	(15.917.391) \$	17.592.906 \$
L&G ESG Green Bond UCITS ETF ³	n. zutr.	n. zutr.	(108.261) €	119.656 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	(436.886) €	482.874 €	(336.684) €	372.124 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	(1.011.382) \$	1.117.844 \$	(999.054) \$	1.104.218 \$
L&G Digital Payments UCITS ETF	(339.786) \$	375.553 \$	(175.662) \$	194.153 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	(835.792) \$	923.770 \$	(740.811) \$	818.791 \$

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(li) Währungsrisiko (Fortsetzung)

	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % steigt 30. Juni 2023	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % fällt 30. Juni 2023	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % steigt 30. Juni 2022	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % fällt 30. Juni 2022
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	(18.146.045) \$	20.056.155 \$	(13.181.637) \$	14.569.178 \$
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF ⁴	(96.495) \$	106.653 \$	n. zutr.	n. zutr.
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF ⁵	(75.777) \$	83.753 \$	n. zutr.	n. zutr.
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ⁵	(23.189) \$	25.630 \$	n. zutr.	n. zutr.
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ⁵	(77.637) \$	85.810 \$	n. zutr.	n. zutr.
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ⁶	(181.516) \$	200.623 \$	n. zutr.	n. zutr.
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ⁶	(198.402) \$	219.286 \$	n. zutr.	n. zutr.
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF ⁷	(364.900) \$	403.310 \$	n. zutr.	n. zutr.

¹

² Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

³ Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

⁴ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

⁵ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

⁶ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

⁷ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko

Das Zinsrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Wert eines Finanzinstruments oder dessen Zahlungsströme aufgrund von Veränderungen der Marktzinsen schwankt.

Das Zinsrisiko eines jeden Fonds wird von den Anlageverwaltern oder dem Unteranlageverwalter in Übereinstimmung mit den Zielen und der Strategie sowie den bestehenden Verfahrensweisen, wie sie im Abschnitt Informationen über die Gesellschaft festgelegt sind, gesteuert. Nach Auffassung der Anlageverwalter besteht für die Fonds mit physischer Nachbildung und mit Ausnahme von Anleihenfonds ein minimales Zinsrisiko, da sich das Risiko auf Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente beschränkt. Schuldtitel unterliegen einem Zinsrisiko. Generell gilt: Der Wert der Schuldtitel fällt in der Regel, wenn die geltenden Zinssätze steigen, und er steigt, wenn die Zinsen fallen. Verändert sich der Wert eines Schuldtitels, so wirkt sich dies gewöhnlich weder auf die Höhe des Ertrags aus, den ein Fonds daraus vereinnahmt, noch auf die Fähigkeit des Fonds, den Nennwert des Wertpapiers bei Fälligkeit zu realisieren. Es kann sich jedoch vor Fälligkeit dieser von einem Fonds gehaltenen und in einem Umfeld mit niedrigeren geltenden Zinsen emittierten Wertpapiere auf den Wert der Fondsanteile auswirken. Zinsrisiken sind generell bei Schuldtiteln mit längeren Laufzeiten oder Durationen stärker ausgeprägt.

Der L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF, der L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF, der L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF, der L&G China CNY Bond UCITS ETF, der L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF, der L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF und der L&G India INR Government Bond UCITS ETF investieren sowohl in fest- als auch in variabel verzinsliche Wertpapiere. Etwaige Zinsänderungen können entweder eine Ertragssteigerung oder einen Ertragsrückgang zur Folge haben oder darin resultieren, dass die Anlageverwalter bei Laufzeitende von Kontrakten oder beim Verkauf von Wertpapieren nicht dazu in der Lage sind, ähnliche Renditen zu sichern.

Das Zins- und Laufzeitenprofil der verzinslichen Anlagen der betreffenden Fonds, einschließlich der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds, kategorisiert entweder nach dem Termin der vertraglich vereinbarten Zinsanpassung oder dem Fälligkeitstermin, je nachdem welcher der beiden Zeitpunkte früher eintritt, lautet zum 30. Juni 2023 wie folgt:

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	Weniger als	3 Monate bis zu	1–5 Jahre	Mehr als	Nicht verzinslich	Insgesamt
	1 Monat	1–3 Monate				
	£	£	£	£	£	£
Vermögenswerte						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	65.626	–	–	–	–	65.626
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet						
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	10.170.730	64.210.235	383.015	74.763.980
– Investitionen in variabel verzinsliche Wertpapiere	–	–	–	18.425.004	303.361	18.728.365
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	1.488.776	1.488.776
Gesamtvermögenswerte	65.626	–	10.170.730	82.635.239	686.376	95.046.747
Verbindlichkeiten						
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(7.112)	(7.112)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	(7.112)	(7.112)
Zinssensitivitätslücke	65.626	–	10.170.730	82.635.239	686.376	95.039.635

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	£	£	£	£	£	£	£
Vermögenswerte							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	2.762.530	25.090.457	49.889.532	–	77.742.519
– Investitionen in variabel verzinsliche Wertpapiere	–	–	187.162	8.836.002	18.015.116	–	27.038.280
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	90.281	90.281
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1.871.532	1.871.532
Gesamtvermögenswerte	–	–	2.949.692	33.926.459	67.904.648	1.961.813	106.742.612
Verbindlichkeiten							
Kontokorrentverbindlichkeiten	(12.887)	–	–	–	–	–	(12.887)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(7.773)	(7.773)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(12.887)	–	–	–	–	(7.773)	(20.660)
Zinssensitivitätslücke	(12.887)	–	2.949.692	33.926.459	67.904.648	1.954.040	106.721.952

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	31.644	–	–	–	–	–	31.644
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	307.146	–	32.563.176	223.343.611	9.985.265	–	266.199.198
– Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	1.126.940	1.126.940
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	518.050	518.050
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	3.607.929	3.607.929
Gesamtvermögenswerte	338.790	–	32.563.176	223.343.611	9.985.265	5.252.919	271.483.761
Verbindlichkeiten							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(1.501.250)	(1.501.250)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(55.519)	(55.519)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(1.556.769)	(1.556.769)
Zinssensitivitätslücke	338.790	–	32.563.176	223.343.611	9.985.265	3.696.150	269.926.992

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	157.824	–	–	–	–	–	157.824
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				–		–	
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	7.892.465	75.073.480	53.450.707	–	136.416.652
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	1.333.636	1.333.636
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1.755.514	1.755.514
Gesamtvermögenswerte	157.824	–	7.892.465	75.073.480	53.450.707	3.089.150	139.663.626
Verbindlichkeiten							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(1.499.122)	(1.499.122)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(34.586)	(34.586)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(1.533.708)	(1.533.708)
Zinssensitivitätslücke	157.824	–	7.892.465	75.073.480	53.450.707	1.555.442	138.129.918

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	102.438	–	–	–	–	–	102.438
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	349.620	836.885	4.103.764	37.630.239	56.526.359	–	99.446.867
– Investitionen in variabel verzinsliche Wertpapiere	173.050	–	139.919	6.148.309	14.963.650	–	21.424.928
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1.281.831	1.281.831
Gesamtvermögenswerte	625.108	836.885	4.243.683	43.778.548	71.490.009	1.281.831	122.256.064
Verbindlichkeiten							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(9.020)	(9.020)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(9.020)	(9.020)
Zinssensitivitätslücke	625.108	836.885	4.243.683	43.778.548	71.490.009	1.272.811	122.247.044

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	805.209	–	–	–	–	–	805.209
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	2.403.826	46.102.358	268.453.616	264.217.087	–	581.176.887
– Investitionen in variabel verzinsliche Wertpapiere	–	5.009.833	8.929.811	47.771.274	52.716.343	–	114.427.261
– Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	8.026.314	8.026.314
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	2.124.100	2.124.100
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	8.914.655	8.914.655
Gesamtvermögenswerte	805.209	7.413.659	55.032.169	316.224.890	316.933.430	19.065.069	715.474.426
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(458.961)	(458.961)
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(8.846.617)	(8.846.617)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(217.785)	(217.785)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(9.523.363)	(9.523.363)
Zinssensitivitätslücke	805.209	7.413.659	55.032.169	316.224.890	316.933.430	9.541.706	705.951.063

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G India INR Government Bond UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	261.115	–	–	–	–	–	261.115
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	–	91.887.067	289.179.871	–	381.066.938
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	7.632.900	7.632.900
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	5.614.299	5.614.299
Gesamtvermögenswerte	261.115	–	–	91.887.067	289.179.871	13.247.199	394.575.252
Verbindlichkeiten							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(7.444.211)	(7.444.211)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(122.985)	(122.985)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(7.567.196)	(7.567.196)
Zinssensitivitätslücke	261.115	–	–	91.887.067	289.179.871	5.680.003	387.008.056

Das Zins- und Laufzeitenprofil der verzinslichen Anlagen der betreffenden Fonds, einschließlich der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds, kategorisiert entweder nach dem Termin der vertraglich vereinbarten Zinsanpassung oder dem Fälligkeitstermin, je nachdem welcher der beiden Zeitpunkte früher eintritt, lauteten zum 30. Juni 2022 wie folgt:

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	£	£	£	£	£	£	£
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	6.860	–	–	–	–	–	6.860
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	221.780	5.902.887	52.598.134	–	–	58.722.801
– Investitionen in variabel verzinsliche Wertpapiere	–	–	–	8.804.183	732.136	–	9.536.319
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	1.032.520	1.032.520
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	882.501	882.501
Gesamtvermögenswerte	6.860	221.780	5.902.887	61.402.317	732.136	1.915.021	70.181.001
Verbindlichkeiten							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(1.279.597)	(1.279.597)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(5.111)	(5.111)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(1.284.708)	(1.284.708)
Zinssensitivitätslücke	6.860	221.780	5.902.887	61.402.317	732.136	630.313	68.896.293
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF							
	£	£	£	£	£	£	£
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	284.218	–	–	–	–	–	284.218
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	950.805	22.213.027	43.031.424	–	66.195.256
– Investitionen in variabel verzinsliche Wertpapiere	–	200.379	100.008	4.525.300	11.903.079	–	16.728.766
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	802.570	802.570
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1.261.637	1.261.637
Gesamtvermögenswerte	284.218	200.379	1.050.813	26.738.327	54.934.503	2.064.207	85.272.447
Verbindlichkeiten							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(595.513)	(595.513)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(6.107)	(6.107)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(601.620)	(601.620)
Zinssensitivitätslücke	284.218	200.379	1.050.813	26.738.327	54.934.503	1.462.587	84.670.827

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	114.723	–	–	–	–	–	114.723
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	8.013.529	65.972.553	4.348.752	–	78.334.834
– Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	3.203	3.203
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	2.381.964	2.381.964
Ausstehende Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	206.602	206.602
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1.158.447	1.158.447
Gesamtvermögenswerte	114.723	–	8.013.529	65.972.553	4.348.752	3.750.216	82.199.773
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(230.420)	(230.420)
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(2.314.725)	(2.314.725)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(15.997)	(15.997)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(2.561.142)	(2.561.142)
Zinssensitivitätslücke	114.723	–	8.013.529	65.972.553	4.348.752	1.189.074	79.638.631
L&G China CNY Bond UCITS ETF¹							
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	75.719	–	–	–	–	–	75.719
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	14.298.514	144.314.405	96.456.620	–	255.069.539
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	2.403.630	2.403.630
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	3.513.675	3.513.675
Gesamtvermögenswerte	75.719	–	14.298.514	144.314.405	96.456.620	5.917.305	261.062.563
Verbindlichkeiten							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(2.475.523)	(2.475.523)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(61.849)	(61.849)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(2.537.372)	(2.537.372)
Zinssensitivitätslücke	75.719	–	14.298.514	144.314.405	96.456.620	3.379.933	258.525.191

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	66.362	–	–	–	–	–	66.362
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	170.100	3.474.355	28.770.555	44.130.705	–	76.545.715
– Investitionen in variabel verzinsliche Wertpapiere	–	–	39.898	5.441.733	8.116.801	–	13.598.432
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	2.015.311	2.015.311
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	900.495	900.495
Gesamtvermögenswerte	66.362	170.100	3.514.253	34.212.288	52.247.506	2.915.806	93.126.315
Verbindlichkeiten							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(1.664.636)	(1.664.636)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(6.579)	(6.579)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(1.671.215)	(1.671.215)
Zinssensitivitätslücke	66.362	170.100	3.514.253	34.212.288	52.247.506	1.244.591	91.455.100

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	5.096.714	29.587.593	399.330.090	390.299.446	–	824.313.843
– Investitionen in variabel verzinsliche Wertpapiere	–	3.535.252	12.981.362	67.411.243	42.614.326	–	126.542.183
– Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	381.052	381.052
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	11.692.825	11.692.825
Ausstehende Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	265.437	265.437
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	14.771.146	14.771.146
Gesamtvermögenswerte	–	8.631.966	42.568.955	466.741.333	432.913.772	27.110.460	977.966.486
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(8.087.405)	(8.087.405)
Kontokorrentverbindlichkeiten	(1.928.273)	–	–	–	–	–	(1.928.273)
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(14.201.291)	(14.201.291)
Fällige Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	(265.714)	(265.714)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(301.257)	(301.257)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(1.928.273)	–	–	–	–	(22.855.667)	(24.783.940)
Zinssensitivitätslücke	(1.928.273)	8.631.966	42.568.955	466.741.333	432.913.772	4.254.793	953.182.546

L&G ESG Green Bond UCITS ETF ¹	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	€	€	€	€	€	€	€
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	14.090.888	–	–	–	–	–	14.090.888
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	14.356	2.222.751	4.889.996	–	7.127.103
– Investitionen in variabel verzinsliche Wertpapiere	–	–	98.159	413.540	475.231	–	986.930
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	271.579	271.579
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	42.564	42.564
Gesamtvermögenswerte	14.090.888	–	112.515	2.636.291	5.365.227	314.143	22.519.064
Verbindlichkeiten							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(325.572)	(325.572)
Fällige Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	(14.045.988)	(14.045.988)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(3.904)	(3.904)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(14.375.464)	(14.375.464)
Zinssensitivitätslücke	14.090.888	–	112.515	2.636.291	5.365.227	(14.061.321)	8.143.600

¹Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G India INR Government Bond UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	101.692	–	–	–	–	–	101.692
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	–	93.037.137	183.777.248	–	276.814.385
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	3.807.034	3.807.034
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	4.187.979	4.187.979
Gesamtvermögenswerte	101.692	–	–	93.037.137	183.777.248	7.995.013	284.911.090
Verbindlichkeiten							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(5.453.987)	(5.453.987)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(89.932)	(89.932)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(5.543.919)	(5.543.919)
Zinssensitivitätslücke	101.692	–	–	93.037.137	183.777.248	2.451.094	279.367.171

Für diejenigen Fonds, die primär zinstragende Wertpapiere halten und somit dem Risiko von Schwankungen bei den vorherrschenden Zinssätzen an den Märkten ausgesetzt sind, überwachen die Anlageverwalter das Risiko der Fonds von Schwankungen der Zinssätze täglich. Auch wenn es sich hauptsächlich um eine Anlageentscheidung handelt, so setzen die Anlageverwalter firmeneigene Systeme und Prozesse ein, um die Fonds am besten zu positionieren, um vom Risiko von Schwankungen bei den vorherrschenden Marktzinssätzen zu profitieren oder dieses Risiko zu begrenzen.

Die folgende Tabelle stellt die geschätzten Auswirkungen eines Anstiegs der Zinssätze um 1 Basispunkt für die einzelnen Fonds, die ein Zinsrisiko tragen, dar. Die Sensitivitätsanalyse basiert auf einer kleinen parallelen Veränderung der Renditekurve (Zinsen aller Fälligkeiten bewegen sich im Einklang).

Ein Rückgang um 1 Basispunkt hätte dieselbe, jedoch gegenteilige Wirkung.

	30. Juni 2023	30. Juni 2022
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	23.630 £	18.992 £
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	64.634 £	54.443 £
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	69.617 \$	19.983 \$
L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹	57.850 \$	105.524 \$
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	79.770 \$	61.611 \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	331.022 \$	457.811 \$
L&G ESG Green Bond UCITS ETF ²	n. zutr.	6.726 €
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	255.604 \$	178.629 \$

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

²Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

B. Kreditrisiko

Das Kreditrisiko ist das Risiko, dass ein Kontrahent eines Finanzinstrumentes einer Verbindlichkeit oder Verpflichtung, die er gegenüber den Fonds der Gesellschaft eingegangen ist, nicht nachkommt.

Zusätzlich zu den von den Anlageverwaltern im Rahmen der täglichen Überwachung von Transaktionen mit den Kontrahenten eingesetzten Verfahren prüfen die Anlageverwalter fortlaufend die Liste der Kontrahenten, um sicherzustellen, dass keine wesentlichen Probleme vorliegen, die die Fähigkeit der Kontrahenten zur Erfüllung ihrer Verpflichtungen beeinträchtigen könnten.

Im Wesentlichen werden alle in den Fonds gehaltenen liquiden Mittel und Wertpapiere über die Verwahrstelle gehalten. The Bank of New York Mellon SA/NV hat zum 30. Juni 2022 ein langfristiges Emittenten-Kreditrating von S&P von AA- (30. Juni 2021: AA-).

Das maximale Kreditrisiko der Gesellschaft in Bezug auf die Fonds mit physischer Nachbildung ist in der Bilanz ausgewiesen.

Der L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF, der L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF, der L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF, der L&G China CNY Bond UCITS ETF, der L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF, der L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF und der L&G India INR Government Bond UCITS ETF sind überwiegend einem Kreditrisiko durch Anlagen in Schuldtiteln ausgesetzt, denen von Standard & Poor's und Moody's ein Investment-Grade-Rating erteilt wurde. Ein solches Kreditrisiko wird von den Anlageverwaltern so gesteuert, wie es durch die Anlageziele der Fonds vorgeschrieben ist.

Schuldtitel unterliegen ebenso tatsächlichen wie „wahrgenommenen“ Maßgaben für die Kreditwürdigkeit. Die Höhe des Kreditrisikos kann anhand des Kreditratings bewertet werden, das dem Emittenten von einer oder mehreren unabhängigen Ratingagenturen erteilt wurde. Das garantiert zwar nicht die Kreditwürdigkeit des Emittenten, liefert aber einen Anhaltspunkt für die Ausfallwahrscheinlichkeit. Wertpapiere mit einem niedrigeren Kreditrating gelten generell als mit höherem Kreditrisiko und einer größeren Ausfallwahrscheinlichkeit behaftet als Wertpapiere mit höheren Ratings. Unternehmen emittieren häufig Schuldtitel, die nach ihrem Rang einstuft sind, was sich bei einem Ausfall in der Priorität niederschlagen würde, mit der die Anleger ausgezahlt werden. Die „Herabstufung“ eines Schuldtitels mit Investment-Grade-Rating oder negative Publicity und Anlegerwahrnehmung, die nicht unbedingt auf fundamentalen Analysen beruhen, könnten den Wert und die Liquidität des Wertpapiers verringern. Das gilt insbesondere, wenn nur wenig gehandelt wird.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Kreditrisiko (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023 geben die nachstehenden Tabellen eine Übersicht über die Kreditrisiken, die sich auf die Kreditratings der in den festverzinslichen Fonds gehaltenen Schuldtiteln stützt:

	L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹
AAA	2,50 %	1,59 %	-	-
AA+	-	0,33 %	-	-
AA-	12,15 %	6,59 %	0,37 %	-
AA-	-	0,62 %	7,70 %	-
A+	19,16 %	11,17 %	8,49 %	100,00 %
A-	22,31 %	20,45 %	1,46 %	-
A	5,53 %	9,62 %	4,64 %	-
BBB+	18,58 %	25,48 %	9,66 %	-
BBB-	3,96 %	2,70 %	14,67 %	-
BBB	9,88 %	14,49 %	7,60 %	-
BB+	-	0,37 %	4,50 %	-
BB-	-	-	5,01 %	-
BB	-	-	10,29 %	-
B+	-	-	6,09 %	-
B-	-	-	1,51 %	-
B	-	-	7,92 %	-
CCC+	-	-	2,31 %	-
CCC-	-	-	2,79 %	-
CC	-	-	0,07 %	-
SD	-	-	0,14 %	-
Ohne Rating	5,93 %	6,59 %	4,06 %	-
WD	-	-	0,72 %	-
	100,00 %	100,00 %	100,00 %	100,00 %

	L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	L&G India INR Government Bond UCITS ETF
AAA	1,17 %	-	-
AA+	1,16 %	0,32 %	-
AA-	4,66 %	7,43 %	-
AA-	0,61 %	3,27 %	-
A+	10,09 %	6,91 %	-
A-	24,04 %	8,17 %	-
A	10,26 %	8,90 %	-
BBB+	19,48 %	10,51 %	-
BBB-	8,36 %	12,09 %	100,00 %
BBB	17,03 %	8,42 %	-
BB+	1,33 %	7,83 %	-
BB-	-	5,99 %	-
BB	0,06 %	6,37 %	-
B+	-	1,90 %	-
B-	-	1,56 %	-
B	-	1,24 %	-
CCC+	-	0,34 %	-
CCC-	-	0,67 %	-
Ohne Rating	1,75 %	8,08 %	-
	100,00 %	100,00 %	100,00 %

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Kreditrisiko (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022 geben die nachstehenden Tabellen eine Übersicht über die Kreditrisiken, die sich auf die Kreditratings der in den festverzinslichen Fonds gehaltenen Schuldtiteln stützt:

	L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	L&G China CNY Bond UCITS ETF ¹
AA+	1,97 %	1,22 %	-	-
AA-	6,49 %	3,24 %	4,67 %	-
AA-	1,36 %	1,76 %	3,74 %	-
A+	11,51 %	5,37 %	3,48 %	81,18 %
A-	17,43 %	19,48 %	7,46 %	-
A	8,53 %	6,55 %	7,42 %	18,82 %
BBB+	21,65 %	31,61 %	6,59 %	-
BBB-	9,13 %	7,23 %	8,13 %	-
BBB	20,17 %	20,74 %	15,08 %	-
BB+	-	1,10 %	5,75 %	-
BB-	-	-	11,24 %	-
BB	-	-	3,72 %	-
B+	-	-	6,65 %	-
B-	-	-	1,08 %	-
B	-	-	8,38 %	-
CCC+	-	-	3,64 %	-
CCC	-	-	0,27 %	-
CC	-	-	0,22 %	-
D	-	-	1,35 %	-
Ohne Rating	1,76 %	1,70 %	1,13 %	-
	100,00 %	100,00 %	100,00 %	100,00 %

¹ Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Kreditrisiko (Fortsetzung)

	L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	L&G ESG Green Bond UCITS ETF	L&G India INR Government Bond UCITS ETF
AAA	1,03 %	-	15,67 %	-
AA+	1,24 %	0,42 %	9,08 %	-
AA-	3,68 %	4,37 %	4,65 %	-
AA-	0,77 %	2,19 %	12,46 %	-
A+	7,86 %	4,72 %	1,96 %	-
A-	21,94 %	9,49 %	14,43 %	-
A	9,70 %	8,76 %	4,31 %	-
BBB+	22,98 %	7,72 %	7,38 %	-
BBB-	10,97 %	14,46 %	4,91 %	100,00 %
BBB	19,01 %	9,95 %	14,60 %	-
BB+	0,39 %	7,00 %	3,54 %	-
BB-	-	10,41 %	0,52 %	-
BB	-	5,57 %	4,39 %	-
B+	-	3,45 %	-	-
B-	-	2,12 %	0,92 %	-
B	-	3,29 %	-	-
CCC+	-	2,12 %	1,18 %	-
CCC	-	0,11 %	-	-
CCC-	-	0,36 %	-	-
D	-	0,04 %	-	-
Ohne Rating	0,43 %	3,45 %	-	-
	100,00 %	100,00 %	100,00 %	100,00 %

(i) Transaktionen mit autorisierten Teilnehmern

Das aus Zeichnungen und Rücknahmen mit autorisierten Teilnehmern resultierende Kreditrisiko bezieht sich auf das mit der Abrechnung von Transaktionen verbundene Risiko. Für den Fall, dass (i) ein autorisierter Teilnehmer in Bezug auf eine Barzeichnung nicht innerhalb der im jeweiligen Prospektnachtrag angegebenen Abwicklungszeit die erforderlichen Barmittel liefert oder (ii) in Bezug auf eine Barzeichnung, die zu einer gezielten Transaktion führt, ein autorisierter Teilnehmer nicht innerhalb der im jeweiligen Prospektnachtrag festgelegten Abwicklungszeit die erforderlichen Barmittel liefert oder der autorisierte designierte Makler die betreffenden Basiswerte (oder einen Teil davon) nicht innerhalb der von der Verwaltungsgesellschaft (oder den von ihr ernannten Delegierten) festgelegten Abwicklungszeit an die Gesellschaft überträgt, behält sich die Gesellschaft und/oder die Verwaltungsgesellschaft (oder ihr ernannter Delegierter) das Recht vor, den betreffenden Zeichnungsantrag zu stornieren.

Für Fonds mit physischer Nachbildung ist das Risiko im Zusammenhang mit nicht abgerechneten Transaktionen begrenzt, denn in den jeweiligen Abrechnungssystemen werden Zeichnungen und Rücknahmen ausnahmslos auf der Basis „Lieferung-gegen-Zahlung“ abgerechnet.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Kreditrisiko (Fortsetzung)

(i) Transaktionen mit autorisierten Teilnehmern (Fortsetzung)

Für Fonds mit physischer Nachbildung kann die Gesellschaft nach Ermessen des Untereinlageverwalters im Zusammenhang mit einem Zeichnungs- und Rücknahmeantrag Transaktionen zum Kauf oder Verkauf von Anlagen mit dem betreffenden autorisierten Teilnehmer (oder einem von diesem beauftragten Makler) abschließen („angewiesene Transaktionen“). Die Abschnitte „Failure to settle“ (Nichtabwicklung) im Abschnitt „Dealing“ (Handel) des Verkaufsprospekts der Gesellschaft legen die Rückgriffvereinbarungen dar, denen zufolge die Gesellschaft Anspruch auf Schadloshaltung durch den betreffenden autorisierten Teilnehmer hat, wenn dieser (oder sein beauftragter Makler) den zeitnahen Abschluss solcher angewiesenen Transaktionen nicht gewährleisten kann.

(ii) Kontrahentenrisiko im Zusammenhang mit der Zahlstelle – Dividenden und Liquidationsgelder von Fonds

Die Zahlstelle („The Bank of New York Mellon, London Branch“) für die Fonds ist dafür zuständig, an den jeweiligen Zahlungsterminen die Zahlungen an Teilnehmer in Bezug auf Dividendengelder und die Erlöse von Zwangsrücknahmen von ETF-Anteilen zu veranlassen.

Vor dem Dividendenzahlungstermin werden die für die an die Teilnehmer zur Ausschüttung als Dividenden bestimmten Gelder von den Barkonten der Gesellschaft bei der Verwahrstelle an die Zahlstelle überwiesen. In der Zwischenzeit werden die Dividendenerträge von der Zahlstelle (oder ihrer angeschlossenen Depotbank) in Form von Barmitteln gehalten, und die Gesellschaft ist in Bezug auf diese Barmittel gegenüber der Zahlstelle und ihrer angeschlossenen Depotbank einem Kreditrisiko ausgesetzt. Bei der Zahlstelle gehaltene Barmittel werden in der Praxis nicht getrennt geführt, sondern stellen Verbindlichkeiten der Zahlstelle (oder ihrer angeschlossenen Depotbank) gegenüber der Gesellschaft als Einleger dar. Im Fall der Insolvenz der Zahlstelle (oder ihrer angeschlossenen Depotbank) wird die Gesellschaft in der Zwischenzeit in Bezug auf die Barmittel als allgemeiner, nicht bevorrechtigter Gläubiger der Zahlstelle (oder ihrer angeschlossenen Depotbank) behandelt. Die Gesellschaft kann auf Schwierigkeiten stoßen und/oder Verzögerungen bei der Beitreibung dieser Verbindlichkeit erleiden oder ist womöglich nicht in der Lage, sie vollständig oder überhaupt beizutreiben, wobei die Gesellschaft in diesem Fall einen Teil oder alle Dividendengelder verlieren kann, die von der Zahlstelle ausgeschüttet werden, was zu einer Reduzierung im Wert eines Fonds führt. Das Risiko für das aktuelle und das vorherige Geschäftsjahr ist null.

C. Liquiditätsrisiko

Das Liquiditätsrisiko ist das Risiko, dass die Gesellschaft in Schwierigkeiten gerät, ihren Verpflichtungen im Zusammenhang mit finanziellen Verbindlichkeiten nachzukommen. Das größte Liquiditätsrisiko der Gesellschaft ergibt sich aus den Rücknahmeanträgen von Anlegern (im Falle der Gesellschaft die autorisierten Teilnehmer). Die Anteilinhaber der Gesellschaft können ihre Anteile an jedem Geschäftstag gegen eine Barzahlung in Höhe des Anteils am NIW des jeweiligen Fonds zurückgeben. Daher ist die Gesellschaft dem Liquiditätsrisiko ausgesetzt, die täglichen Rücknahmeanträge ihrer Anteilinhaber auszuführen.

Die Fonds ermöglichen die Zeichnung und Rückgabe von Anteilen und sind daher einem Liquiditätsrisiko im Zusammenhang mit Rückgaben durch Anteilinhaber gemäß den Bestimmungen des Verkaufsprospekts ausgesetzt. Diese Bestimmungen schließen die Möglichkeit ein, Rücknahmedividenden in bar oder Sachleistungen zu zahlen oder Rücknahmen an jeweils einem Handelstag auf 10 % des NIW des jeweiligen Fonds zu beschränken. Die Portfolios werden so verwaltet, dass ausreichend liquide Anlagen vorhanden sind, um den normalen Liquiditätsbedarf zu decken. Bei Anteilsrücknahmen in größerem Umfang kann es jedoch erforderlich werden, dass die Fonds ihre Anlagen schneller liquidieren als wünschenswert, um liquide Mittel für Rücknahmen zu beschaffen. Diese Faktoren können sich negativ auf den Wert der zurückgenommenen Anteile und die Bewertung der noch umlaufenden Anteile auswirken sowie auf die Liquidität der verbleibenden Anteile, wenn die liquideren Vermögenswerte verkauft wurden, um die Rücknahmen durchzuführen.

Die Gesellschaft kann die Berechnung des NIW und die Zeichnung und Rücknahme von Anteilen eines oder mehrerer Fonds unter bestimmten Umständen aussetzen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

C. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Der Verwaltungsrat kann vorbehaltlich der Regeln maßgeblicher zentraler Abwicklungssysteme und/oder der Regeln einer maßgeblichen Börsen eine zeitweilige Aussetzung der Bestimmung des NIW von bestimmten Klassen und der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen jedweder Klassen beschließen:

- I. während der gesamten Dauer oder Teilen eines Zeitraums, in dem einer der Hauptmärkte, an dem ein wesentlicher Teil der Werte des Index, auf den sich der betreffende Fonds oder die Anlagen des betreffenden Fonds beziehen, notiert oder gelistet ist oder gehandelt wird, oder eines Zeitraums, in dem die Devisenmärkte für die Basiswährung des Fonds oder die Währung, auf die ein wesentlicher Teil der Titel des Index, auf den sich der betreffende Fonds oder die Anlagen des betreffenden Fonds beziehen, lauten, geschlossen sind (außer während der üblichen Schließungszeiten an Wochenenden oder normalen Feiertagen) oder eines Zeitraums, während dessen der dortige Handel eingeschränkt oder ausgesetzt ist oder der Handel an einer Terminbörse oder einem relevanten Terminmarkt ausgesetzt ist;
- II. während der gesamten Dauer oder Teilen eines Zeitraums, in dem aufgrund politischer, wirtschaftlicher, militärischer oder währungsbezogener Ereignisse oder anderer Umstände, die nicht dem Einfluss, der Verantwortung oder der Macht des Verwaltungsrats unterliegen, eine Veräußerung oder Bewertung von Anlagen des betreffenden Fonds nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht ohne Nachteile für die Interessen der Anteilhaber im Allgemeinen oder der Inhaber von Anteilen des betreffenden Fonds in angemessener Weise durchführbar ist, oder falls der NIW nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht in angemessener Weise berechnet werden kann oder die Veräußerung erhebliche Nachteile für die Anteilhaber im Allgemeinen oder die Inhaber von Anteile des betreffenden Fonds zur Folge hätte;
- III. während der gesamten Dauer oder in Teilen eines Zeitraums, in dem die normalerweise für die Ermittlung des Werts einer der Anlagen der Gesellschaft verwendeten Kommunikationsmittel ausfallen, oder in dem aus irgendeinem Grund der Wert einer der Anlagen oder anderen Vermögenswerte des betreffenden Fonds nicht in angemessener oder gerechtfertigter Weise festgestellt werden kann;
- IV. während der gesamten Dauer oder in Teilen eines Zeitraums, in dem die Gesellschaft nicht in der Lage ist, Gelder zurückzuführen, die für Rücknahmezahlungen erforderlich sind, oder in dem solche Zahlungen nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht zu normalen Preisen oder normalen Wechselkursen durchgeführt werden können, oder in dem bei der Übertragung von Geldern oder Vermögenswerten, die für Zeichnungen, Rücknahmen oder Handelsgeschäfte erforderlich sind, Probleme bestehen oder voraussichtlich auftreten werden;
- V. nach Ermessen des Verwaltungsrats unter Umständen, unter denen der Verwaltungsrat eine solche Aussetzung als im besten Interesse der Gesellschaft oder des Fonds oder der Anleger des Fonds insgesamt betrachtet;
- VI. nach Veröffentlichung einer Bekanntmachung zur Einberufung einer Hauptversammlung von Anteilhabern, auf der die Abwicklung der Gesellschaft oder die Schließung eines Fonds beschlossen werden soll;
- VII. wenn der Handel mit den Anteilen an einer relevanten Börse, an der sie notiert sind, eingeschränkt oder ausgesetzt wird;
- VIII. wenn die Abwicklung oder Abrechnung von Wertpapieren in einem anerkannten Clearing- und Abrechnungssystem unterbrochen ist;
- IX. in einem Zeitraum, in dem der Handel mit Anteilen aufgrund einer Verfügung oder Anordnung einer zuständigen Regulierungsbehörde ausgesetzt ist;
- X. in jedem Zeitraum, in dem ein Index nicht zusammengestellt oder veröffentlicht wird.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

C. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Der Zentralbank und den relevanten Börsen wird unverzüglich (und in jedem Fall während der Geschäftstage, an dem die Aussetzung erfolgt/endet) eine Benachrichtigung über Anfang und Ende eines Aussetzungszeitraums erteilt und soweit gesetzlich vorgeschrieben oder in der Praxis des betreffenden Landes üblich, auch weiteren zuständigen Behörden in einem Mitgliedstaat oder anderem Land, in dem die Anteile zum Vertrieb registriert sind. Diese Mitteilung ist auch in derjenigen bzw. denjenigen Publikation(en) zu veröffentlichen, die vom Verwaltungsrat bestimmt werden kann/ können, und ist in jedem Fall über die Medien zu kommunizieren, über die Anteilspreise veröffentlicht werden.

Ferner werden die Personen benachrichtigt, die Zeichnungs- oder Rücknahmeanträge für Anteile des/der betreffenden Fonds stellen. Sämtliche Zeichnungs- oder Rücknahmeanträge für Anteile, die während eines Aussetzungszeitraums eingehen, werden normalerweise auf den nächsten Handelstag verschoben.

Die Gesellschaft wird, sofern möglich, alle erforderlichen Schritte unternehmen, um eine Aussetzung so bald wie möglich zu beenden.

Falls die Gesamtzahl der Rücknahmeanträge an einem Handelstag in Bezug auf einen Fonds 10 % oder mehr des NIW dieses Fonds beträgt, kann jeder Rücknahmeantrag für Anteile dieses Fonds nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft soweit reduziert werden, dass die Gesamtzahl der zurückzunehmenden Anteile dieses Fonds an diesem Handelstag 10 % des NIW dieses Fonds nicht übersteigt. Jeder Teil eines Antrags auf Rücknahme, der infolge der Ausübung dieses Rechts durch die Verwaltungsgesellschaft nicht bearbeitet wurde, wird so behandelt, als ob ein auf den nächsten und jeden nachfolgenden Handelstag bezogener Antrag gestellt wurde (für die dasselbe Recht der Verwaltungsgesellschaft gilt), bis die ursprünglichen Anträge vollständig erfüllt worden sind.

Während einer solchen Aussetzung kann es für Anleger schwierig werden, Anteile auf dem Sekundärmarkt zu kaufen oder zu verkaufen, und der Sekundärmarktpreis entspricht gegebenenfalls nicht dem NIW je Anteil. Falls die Gesellschaft die Zeichnung und/oder Rücknahme von Anteilen eines Fonds aussetzen muss oder eine Börse, an der die Anlagen eines Fonds gehandelt werden, geschlossen wird, ist damit zu rechnen, dass Abschlüsse oder Aufschläge in größerem Umfang entstehen können.

Sämtliche Verbindlichkeiten zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 sind, abgesehen von Devisenterminkontrakten, die innerhalb von zwei Monaten fällig sind, in weniger als einem Monat fällig.

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung

A. Risiken im Zusammenhang mit dem Einsatz von OTC-Swaps

Der Einsatz von OTC-Swaps ist mit verschiedenen Risiken verbunden, u. a. gibt es keine Garantie dafür, dass ein Fonds sein erklärtes Anlageziel erreicht. Ein Fonds kann zudem aus verschiedenen Gründen die gewünschte Rendite von einem Kontrahenten nicht erhalten, unter anderem aus folgenden:

- eine wesentliche Steigerung der Kosten des Kontrahenten für die Absicherung seines Engagements in einem Fonds unter dem OTC-Swap (z. B. dadurch, dass eine physische Position in den in einem Index vertretenen Wertpapieren gehalten wird) oder eine wesentliche Veränderung oder Verhinderung dieser Absicherung, die zu einer Änderung der Bedingungen des OTC-Swaps, einer Erhöhung der durch einen Fonds an einen Kontrahenten zu zahlenden Gebühren, einer aufgeschobenen oder reduzierten Renditeauszahlung unter den OTC-Swaps, der Auszahlung der Rendite unter den OTC-Swaps in der Währung des Hedge-Geschäfts oder der physischen Abwicklung oder Auflösung des OTC-Swaps führt;

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Risiken im Zusammenhang mit dem Einsatz von OTC-Swaps (Fortsetzung)

- eine Erhöhung oder Reduzierung des Engagements eines Fonds in einem Index durch den OTC-Swap infolge der Ausgabe oder Rücknahme von Anteilen eines Fonds. Aufgrund der Kosten und in Abhängigkeit von der Methode für diese Maßnahmen ist es möglich, dass der Preis, zu dem der Fonds Anteile ausgibt oder zurücknimmt, nicht exakt dem Preis entspricht, zu dem der Fonds diese Anteile hätte ausgeben oder zurücknehmen können, wenn der Fonds direkt in die jeweiligen Indexwerte investiert hätte;
- Die Auflösung eines OTC-Swaps vor Ablauf der festgelegten Frist aus Gründen wie zum Beispiel der Änderung oder Einstellung des relevanten Index oder der Referenzwerte für den betreffenden Fonds, Illegalität, wesentliche Hindernisse für den Kontrahenten, seine Absicherung aufrechtzuerhalten oder zu leisten, Verzug oder Marktstörungen. Wird ein OTC-Swap frühzeitig aufgelöst, muss der betreffende Fonds möglicherweise an den Kontrahenten eine Auflösungszahlung leisten, was sowohl das Engagement des Fonds im betreffenden Index als auch die Rendite der Anteilinhaber des Fonds verringern würde.
- Am Ende der Laufzeit eines OTC-Swaps muss die Gesellschaft einen neuen OTC-Swap eingehen. Möglicherweise kann kein OTC-Swap mit ähnlichen Vereinbarungen und Bedingungen eingegangen werden wie der ursprüngliche OTC-Swap;
- das Erzielen einer Rendite für den Fonds am Ende der vorgesehenen Laufzeit des OTC-Swaps basiert auf der Performance eines Index zu einem bestimmten vom Kontrahenten festgelegten Zeitpunkt. Die Methode für die Ermittlung dieses Werts kann Verzögerungen bedingen und bedeuten, dass der Preis, zu dem die Anteile am Ende der Laufzeit eines OTC-Swaps zurückgenommen werden, nicht genau dem Wert des Index entspricht.
- Die Bewertung eines Index kann aufgrund von Marktstörungen, die im betreffenden OTC-Swap spezifiziert sind, beeinträchtigt werden oder sich verzögern;
- das Kreditrisiko durch die Insolvenz oder Unfähigkeit eines Kontrahenten eines OTC-Swap, seine Verpflichtungen unter dem OTC-Swap zu erfüllen, die zu einem Verlust für einen Fonds und zu einer eventuell wesentlichen Auswirkung auf die Anlageperformance der Fonds führt. Bitte beachten Sie, dass vorstehendes Kontrahentenrisiko durch den Umstand verringert wird, dass der jeweilige Gewinn/Verlust aus dem Index-Swap durch die Beteiligten täglich bar besichert wird (in der Basiswährung des betreffenden Fonds). Um tägliche Übertragungen unwesentlicher Barbeträge zu vermeiden, erfolgen Übertragungen von Barsicherheiten lediglich in der Höhe, in der der jeweilige Gewinn-/Verlustbetrag an einem bestimmten Tag den vereinbarten Mindestübertragungsbetrag für den betreffenden Fonds übersteigt (wobei solche Mindestübertragungsbeträge gemäß den von der Europäischen Marktinfrastrukturverordnung („EMIR“) vorgeschriebenen Grenzen festgelegt werden);
- Wechselkursveränderungen zwischen der Basiswährung eines Fonds und der Denominationswährung können dazu führen, dass der Wert des OTC-Swaps aufgrund der Einflüsse der Wechselkurse auf die Indexwerte steigt oder fällt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

A. Risiken im Zusammenhang mit dem Einsatz von OTC-Swaps (Fortsetzung)

- staatliche Interventionen auf europäischer, internationaler und nationaler Ebene, einschließlich neuer, sich auf die jeweiligen Produkte und Märkte auswirkender Gesetze, wozu insbesondere EMIR und der Dodd-Frank Act gehören können, die sich auf die künftige Fähigkeit der Gesellschaft zum Eingehen oder Fortsetzen dieser OTC-Swap-Transaktionen auswirken und/oder die diesbezüglichen Kosten erhöhen können.
- Unter bestimmten Umständen können Bewertungen für OTC-Swaps und/oder Indizes nur von einer begrenzten Anzahl Marktteilnehmer verfügbar sein, die möglicherweise gleichzeitig Kontrahenten dieser Transaktionen sind. Bei der Bewertung oder Glättstellung einer Position eines OTC-Swaps, der eingesetzt wird, um einen Index nachzubilden, kann unter diesen Umständen anstelle des tatsächlichen Werts des Index ein bereinigter Index-Wert oder die Hedging-Positionen, die der Kontrahent des OTC-Swaps eingegangen ist, um diesen Index nachzubilden, herangezogen werden, und diese Werte können wesentlich voneinander abweichen. Bewertungen von Seiten solcher Marktteilnehmer können daher subjektiv sein, und es können wesentliche Unterschiede zwischen den verfügbaren Bewertungen bestehen und/oder
- die Gebührenstruktur des Fonds, was bedeutet, dass die Formeln, anhand derer die Renditen eines Fonds unter dem jeweiligen OTC-Swap berechnet werden, variieren, so dass sich die erwarteten Renditen für die Anteilinhaber ändern (möglicherweise auch reduzieren).

B. Marktrisiko

Das Marktrisiko ist das Risiko, dass der Wert von gehaltenen Instrumenten aufgrund von Veränderungen der Marktpreise, die durch das Preisrisiko, das Währungsrisiko und das Zinsrisiko bedingt sind, schwankt.

(i) Preisrisiko

Das Preisrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder künftige Cashflows eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktpreise (außer solchen, die sich aus Zins- oder Währungsrisiken ergeben) schwanken, wobei diese Veränderungen durch spezifische Faktoren des einzelnen Finanzinstruments oder seines Emittenten bedingt sein können oder durch Faktoren, welche ähnliche am Markt gehandelte Instrumente beeinflussen.

Einige der Fonds mit synthetischer Nachbildung streben eine gehebelte Rendite oder gehebelte inverse Rendite (d. h. Short-Rendite) gegenüber der Wertentwicklung eines weltweit anerkannten Referenzindex an (d. h. DAX 30 oder FTSE 100) (jeweils der „Basisindex“).

Leveraged Funds (gehebelte Fonds)

Um eine gehebelte Rendite gegenüber einem Basisindex zu erzielen, bildet ein Fonds eine gehebelte Version des jeweiligen Basisindex ab (jeweils ein „gehebelter Index“), die den Faktor 2 der täglichen prozentualen Veränderung im Niveau des jeweiligen Basisindex abzüglich eines impliziten Betrags erzielen soll, der die Kosten für die Aufnahme zusätzlichen Kapitals zur Investition in das Indexportfolio wiedergibt, um die gehebelte Position herzustellen, und sich aus einem Tagesgeldsatz und einem Liquiditäts-Spread zusammensetzt, aus dem die Kosten für die Beschaffung langfristiger Liquidität zur Finanzierung der gehebelten Position hervorgehen (die „Finanzierungskosten“).

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(i) Preisrisiko (Fortsetzung)

Leveraged Funds (Fortsetzung)

Dies bedeutet, dass der Fonds darauf abzielt, für seine Anteilhaber eine gehebelte Rendite zu erzielen, die der doppelten täglichen prozentualen Veränderung des Basiswerts an diesem Tag, abzüglich der in die gehebelte Methodik eingebetteten Finanzierungskosten und der auf Fondsebene erhobenen Kosten und Gebühren entspricht.

Für den Fall, dass der Index an einem bestimmten Tag eine positive Rendite aufweist, sollte der Fonds eine positive Rendite verzeichnen, die der doppelten prozentualen Veränderung im Niveau des Basisindex an diesem Tag entspricht (vor Anpassung um die in die gehebelte Methodik eingebetteten Finanzierungskosten und die auf Fondsebene erhobenen Kosten und Gebühren).

Entsprechend gilt für den Fall, dass der Index an einem bestimmten Tag eine negative Rendite aufweist, dass der Fonds eine negative Rendite verzeichnen sollte, die der doppelten prozentualen Veränderung im Niveau des Basisindex an diesem Tag entspricht (vor Anpassung um die in die gehebelte Methodik eingebetteten Finanzierungskosten und die auf Fondsebene erhobenen Kosten und Gebühren).

Dementsprechend richtet sich das Risiko eines gehebelten Fonds direkt nach den Wertschwankungen des Basisindex und seiner Komponenten.

Leveraged Inverse Funds (gehebelte inverse Fonds)

Um eine gehebelte inverse Rendite gegenüber einem Basisindex zu erzielen, bildet ein Fonds eine gehebelte inverse Version des jeweiligen Basisindex (jeweils ein „gehebelter inverser Index“) ab, die die doppelte tägliche prozentuale Veränderung im Niveau des Basisindex auf inverser Basis zuzüglich eines impliziten Betrags abwirft, aus dem die aufgelaufenen Zinsen auf die Barerlöse aus der Veräußerung des Indexportfolios (der „Tagesgeldsatz“) abzüglich eines impliziten Betrags hervorgehen, der die Kosten für die Entleiherung des Indexportfolios zur Aufrechterhaltung des gehebelten Short-Engagements wiedergibt (die „Kreditkosten“).

Dies bedeutet, dass der Fonds darauf abzielt, für seine Anteilhaber eine inverse Rendite zu erzielen, die der doppelten täglichen prozentualen Veränderung im Niveau des Basisindex auf inverser Basis an diesem Tag, zuzüglich des Tagesgeldsatzes und abzüglich Finanzierungskosten (beides in die gehebelte Methodik eingebettet) und der auf Fondsebene erhobenen Kosten und Gebühren entspricht.

Für den Fall, dass der Index an einem bestimmten Tag eine positive Rendite aufweist, sollte der Fonds eine positive Rendite verzeichnen, die der doppelten täglichen prozentualen Veränderung im Niveau des Basisindex auf inverser Basis an diesem Tag entspricht (vor Anpassung um den in die gehebelte Methodik eingebetteten Tagesgeldsatz und die eingebetteten Kreditkosten und um die auf Fondsebene erhobenen Kosten und Gebühren).

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(i) Preisrisiko (Fortsetzung)

Leveraged Inverse Funds (Fortsetzung)

Entsprechend gilt für den Fall, dass der Index an einem bestimmten Tag eine negative Rendite aufweist, dass der Fonds eine negative Rendite verzeichnet, die der doppelten prozentualen Veränderung im Niveau des Basisindex auf inverser Basis an diesem Tag entspricht (vor Anpassung um den in die gehebelte Methodik eingebetteten Tagesgeldsatz und die eingebetteten Kreditkosten und um die auf Fondsebene erhobenen Kosten und Gebühren).

Dementsprechend richtet sich das Risiko eines gehebelten inversen Fonds direkt nach den Wertschwankungen des Basisindex und seiner Komponenten.

Ein Fonds, der einen gehebelten inversen Index nachbildet, ist möglicherweise nicht für Anlagen über längere Zeiträume geeignet. Aufgrund der täglichen Neuanpassung des Index kann die tatsächliche Wertveränderung des Fonds wesentlich von der Veränderung der inversen Rendite des Index, multipliziert mit einem Hebelfaktor 2, (der „nicht angepassten gehebelten Rendite“) abweichen.

Auch Preisvolatilität kann dazu führen, dass die langfristigen Renditen des Fonds wesentlich von der nicht angepassten gehebelten Rendite abweichen. Die tägliche Neuanpassung des Index kann bewirken, dass der Index am Tag nach einer solchen Neuanpassung im Vergleich zur nicht angepassten gehebelten Rendite stärker oder geringer gehebelt ist. Dementsprechend kann dies zu einer Underperformance des Fonds im Vergleich zur Performance aus der nicht angepassten gehebelten Rendite führen. Auch nach Berücksichtigung des Tagesgeldsatzes und der Kreditkosten, die mit der gehebelten Index-Methodik Anwendung verbunden sind, und der auf Fondsebene anfallenden Gebühren und Kosten sollten Anleger nicht erwarten, dass die tatsächliche prozentuale Rendite für Anteile im Fonds über Zeiträume von mehr als einem Tag der prozentualen Veränderung der nicht angepassten gehebelten Rendite entspricht.

In der nachstehenden Tabelle sind die Fonds aufgeführt, die gehebelte Indizes oder gehebelte inverse

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(i) Preisrisiko (Fortsetzung)

Eine Anlage in einen Fonds, der einen gehebelten Index oder einen gehebelten inversen Index nachbildet, setzt einen Anleger den Marktrisiken aus, die mit den Schwankungen im Basisindex und im Wert der im Basisindex enthaltenen Wertpapiere verbunden sind. Aufgrund der inhärenten Hebelwirkung des gehebelten Index bzw. des gehebelten inversen Index ist das Marktrisiko größer als beim Basisindex.

Weitere Informationen entnehmen Sie bitte den fondsspezifischen Risikofaktoren in den fondsspezifischen Nachträgen zum Verkaufsprospekt der Gesellschaft und dem Abschnitt „Gehebelte Rendite und inverse Rendite“ des Verkaufsprospekts der Gesellschaft, welche weitere Informationen zu den Fonds enthalten, die gehebelte Indizes und gehebelte inverse Indizes nachbilden.

(ii) Währungsrisiko

Das Währungsrisiko ist das Risiko, dass der Wert des auf die Funktionalwährung eines Fonds lautenden Nettovermögens eines Fonds aufgrund von Wechselkursveränderungen schwankt.

Die Fonds mit synthetischer Nachbildung hielten in diesem und im vorherigen Geschäftsjahr OTC-Swaps, die in der Funktionalwährung der jeweiligen Fonds ausgegeben wurden, und alle anderen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten lauteten auf die Funktionalwährung des jeweiligen Fonds.

(iii) Zinsrisiko

Das Zinsrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Wert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktzinsen schwankt. Sämtliche Fonds der Gesellschaft mit synthetischer Nachbildung halten in erster Linie Swaps, deren Zinsflüsse ganz oder teilweise durch die Erträge auf gehaltene umgekehrte Pensionsgeschäfte kompensiert werden. Die Anlageverwalter sind der Meinung, dass nur ein geringes Zinsrisiko besteht, da sich das Risiko auf liquide Mittel beschränkt, die in kurzfristige Investmentfonds eingebracht werden. Diese Beträge werden als Geldmarktinstrumente in der Bilanz eines jeden Fonds ausgewiesen.

Das Zinsrisiko eines jeden Fonds wird von den Anlageverwaltern oder dem Unteranlageverwalter in Übereinstimmung mit den Zielen und der Strategie sowie den bestehenden Verfahrensweisen, wie sie im Abschnitt Informationen über die Gesellschaft festgelegt sind, gesteuert.

Die in der Tabelle dargestellten derivativen Finanzinstrumente stellen den nicht realisierten Gewinn/Verlust aus den Positionen im Gegensatz zu dem von der Position generierten Gesamtexposure dar, welches rund 100 % des Werts des Fonds beträgt. Die von den Fonds vereinnahmten Zinserträge dienen der Finanzierung der Zinsverbindlichkeiten aus den Swap-Positionen.

Die Zinssensitivitätslücke gilt als unwesentlich, da jede Zinsbewegung, die sich auf die Positionen in umgekehrten Pensionsgeschäften auswirkt, durch Bewegungen der für derivative Finanzinstrumente ausgewiesenen Positionen nicht realisierter Gewinne/Verluste neutralisiert werden würde. Aus diesem Grund wird keine Sensitivitätsanalyse angegeben.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Das Zins- und Laufzeitenprofil der variabel verzinslichen Anlagen der betreffenden Fonds, einschließlich der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds, kategorisiert entweder nach dem Termin der vertraglich vereinbarten Zinsanpassung oder dem Fälligkeitstermin, je nachdem welcher der beiden Zeitpunkte früher eintritt, lauteten zum 30. Juni 2023 wie folgt:

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.628	–	–	–	–	–	1.628
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	14.310.000	–	–	–	–	–	14.310.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				–		–	
–Geldmarktinstrumente	20.064.103	–	–	–	–	–	20.064.103
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	426.422.859	–	–	–	–	–	426.422.859
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	510.850	510.850
Gesamtvermögenswerte	460.798.590	–	–	–	–	510.850	461.309.440
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(9.243.839)	(9.243.839)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(540.835)	(540.835)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(9.784.674)	(9.784.674)
Zinssensitivitätslücke	460.798.590	–	–	–	–	(9.273.824)	451.524.766

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	180.000	–	–	–	–	–	180.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				–		–	
–Geldmarktinstrumente	2.895.109	–	–	–	–	–	2.895.109
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	192.143	192.143
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	30.889.828	–	–	–	–	–	30.889.828
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	12.901	12.901
Gesamtvermögenswerte	33.964.937	–	–	–	–	205.044	34.169.981
Verbindlichkeiten							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(55.741)	(55.741)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(55.741)	(55.741)
Zinssensitivitätslücke	33.964.937	–	–	–	–	149.303	34.114.240

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	72.280.000	–	–	–	–	–	72.280.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	118.468.861	–	–	–	–	–	
–Geldmarktinstrumente	1.544.114.955	–	–	–	–	–	118.468.861
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			–	–	–	–	1.544.114.955
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1.353	1.353
Gesamtvermögenswerte	1.734.863.816	–	–	–	–	1.353	1.734.865.169
–							
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(53.399.875)	(53.399.875)
Kontokorrentverbindlichkeiten	(3.145)	–	–	–	–	–	(3.145)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(2.117.625)	(2.117.625)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(3.145)	–	–	–	–	(55.517.500)	(55.520.645)
Zinssensitivitätslücke	1.734.860.671	–	–	–	–	(55.516.147)	1.679.344.524

Das Zins- und Laufzeitenprofil der variabel verzinslichen Anlagen der betreffenden Fonds, einschließlich der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds, kategorisiert entweder nach dem Termin der vertraglich vereinbarten Zinsanpassung oder dem Fälligkeitstermin, je nachdem welcher der beiden Zeitpunkte früher eintritt, lauteten zum 30. Juni 2022 wie folgt:

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	28.330.000	–	–	–	–	–	28.330.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	49.574.992	–	–	–	–	–	49.574.992
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	623.438.724	–	–	–	–	–	623.438.724
Ausstehende Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	1.553.234	1.553.234
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1.401	1.401
Gesamtvermögenswerte	701.343.716	–	–	–	–	1.554.635	702.898.351
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(44.009.038)	(44.009.038)
Kontokorrentverbindlichkeiten	(78.231)	–	–	–	–	–	(78.231)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(650.855)	(650.855)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(78.231)	–	–	–	–	(44.659.893)	(44.738.124)
Zinssensitivitätslücke	701.265.485	–	–	–	–	(43.105.258)	658.160.227
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF							
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	90.620	–	–	–	–	–	90.620
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	2.341.426	–	–	–	–	–	2.341.426
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	29.294.923	–	–	–	–	–	29.294.923
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	10.587	10.587
Gesamtvermögenswerte	31.726.969	–	–	–	–	10.587	31.737.556
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(869.132)	(869.132)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(18.614)	(18.614)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	–	–	–	–	–	(887.746)	(887.746)
Zinssensitivitätslücke	31.726.969	–	–	–	–	(877.159)	30.849.810

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1–3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1–5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Vermögenswerte							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	21.010.000	–	–	–	–	–	21.010.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Geldmarktinstrumente	80.360.375	–	–	–	–	–	80.360.375
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	795.902.955	–	–	–	–	–	795.902.955
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	74.562	74.562
Gesamtvermögenswerte	897.273.330	–	–	–	–	74.562	897.347.892
Verbindlichkeiten							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(57.878.638)	(57.878.638)
Kontokorrentverbindlichkeiten	(40.368)	–	–	–	–	–	(40.368)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(666.302)	(666.302)
Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(40.368)	–	–	–	–	(58.544.940)	(58.585.308)
Zinssensitivitätslücke	897.232.962	–	–	–	–	(58.470.378)	838.762.584

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Für die Fonds mit synthetischer Nachbildung ist keine Zinssensitivitätsanalyse erforderlich, da sie einen relativen VaR-Ansatz heranziehen.

C. Kreditrisiko

Das Kreditrisiko ist das Risiko, dass ein Kontrahent eines Finanzinstrumentes einer Verbindlichkeit oder Verpflichtung, die er gegenüber den Fonds der Gesellschaft eingegangen ist, nicht nachkommt. Da die Fonds mit synthetischer Nachbildung in erster Linie OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt, besteht ein Kreditrisiko durch die Parteien, mit denen diese Geschäfte getätigt werden, und diese sind in Anmerkung 5 („Sicherheiten“) angegeben.

(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Die Fonds mit synthetischer Nachbildung setzen Total Return Index Swaps ein, die mit einem oder mehreren OTC-Swap-Kontrahenten eingegangen werden (im laufenden und vorangegangenen Geschäftsjahr mit Barclays Bank Plc und Merrill Lynch International), um die Wertentwicklung des betreffenden Index nachzubilden.

Da alle OTC-Swaps „unfunded“ Swaps sind, behält der Fonds die von einem Fonds aus Zeichnungen vereinnahmten Barmittel (d. h., sie werden im Gegensatz zu einem „funded“ Swap nicht auf die Swap-Kontrahenten übertragen). Die Anlageverwalter verwalten die einbehaltenen Barmittel gemäß den Richtlinien der Gesellschaft zum effizienten Portfolio-(Liquiditäts-)Management durch Anlage:

- des größten Teils der Barmittel in umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Repo-Kontrahenten, denen zufolge die Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) die Barmittel gegen Wertpapiere tauscht, die von dem Repo-Kontrahenten (mit vollständigem Eigentumsrecht) auf die Gesellschaft übertragen werden, vorbehaltlich einer Verpflichtung des Kontrahenten, die Wertpapiere auf Verlangen von der Gesellschaft zurückzukaufen („umgekehrte Pensionsgeschäfte“). Dokumentiert werden die umgekehrten Pensionsgeschäfte mittels eines Rahmenvertrages zum Sicherheitenmanagement zwischen der Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) und The Bank of New York Mellon (dem „Sicherheitenverwalter“), an den die Eröffnung und Führung der Sicherheitenkonten von der Verwahrstelle delegiert wurde.

Die an die Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) übertragenen Wertpapiere müssen bestimmten Zulassungskriterien genügen. Die als Sicherheiten gehaltenen Wertpapiere werden täglich bewertet (d. h. zum Marktwert). Soweit ihr Wert unter dem nominellen Barwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte liegt (d. h. dem Wert der an den Repo-Kontrahenten übertragenen Barmittel), ist der Repo-Kontrahent verpflichtet, weitere Wertpapiere als Sicherheiten (auf Rechnung des betreffenden Fonds) an die Gesellschaft zu übertragen, damit sie dem nominellen Barwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte entsprechen. Soweit der Wert der als Sicherheiten gehaltenen Wertpapiere dagegen über dem nominellen Barwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte liegt, überträgt die Gesellschaft den (entsprechenden) Anteil an den Wertpapieren an den Repo-Kontrahenten zurück.

- eines kleinen Teils der Barmittel in OGAW-AAA-Geldmarktfonds, die nicht von der Gesellschaft, der Verwaltungsgesellschaft oder Konzernunternehmen der ETF Securities verwaltet werden oder diesen anderweitig nahe stehen (Short-Term Investment Funds, „STIFs“). STIFs werden eingesetzt, weil sie tägliche Liquidität bieten. Daher kann bei einer Nachschussforderung aus dem Swap (siehe nachstehenden Absatz) ein Teil der in STIF gehaltenen Barmittel rasch flüssig gemacht und an den Swap-Kontrahenten übertragen werden.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

C. Kreditrisiko (Fortsetzung)

(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte (Fortsetzung)

Steigt oder fällt der Wert des jeweils von einem Fond nachgebildeten Index, verbuchen die mit einem Swap-Kontrahenten eingegangenen Total Return Index Swaps einen Gewinn oder Verlust für den Fonds. Der Gewinn oder Verlust aus dem Swap wird zwischen der Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) und dem Swap-Kontrahenten monatlich abgerechnet. Innerhalb eines Monats übertragen die Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) und der Swap-Kontrahent jeweils Barsicherheiten (ausschließlich in der Basiswährung des Fonds) in einer Höhe, die dem täglichen Gewinn/Verlust aus dem Index-Swap entspricht, soweit der jeweilige Gewinn/Verlust einen vereinbarten Schwellenbetrag übersteigt. Um tägliche Übertragungen unwesentlicher Barbeträge zu vermeiden, erfolgen Übertragungen von Barsicherheiten lediglich in der Höhe, in der der jeweilige Gewinn-/Verlustbetrag an einem Tag den vereinbarten Mindestübertragungsbetrag für den betreffenden Fonds übersteigt, der gemäß den von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank vorgeschriebenen Grenzen und EMIR festgelegt wird.

Von dem Swap-Kontrahenten als Sicherheit für den Swap an die Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) übertragene Barmittel sind im von den Anlageverwaltern festgelegten Verhältnis in umgekehrte Pensionsgeschäfte und in die STIFs (wie vorstehend beschrieben) investiert. Muss die Gesellschaft dagegen (auf Rechnung des betreffenden Fonds) im Rahmen des Swaps Barsicherheiten an den Swap-Kontrahenten übertragen, löst sie einen Teil der umgekehrten Pensionsgeschäfte/STIFs auf, sodass der entsprechende Betrag gedeckt ist.

Zum Bilanzstichtag wurden alle Barsicherheiten, die in Bezug auf OTC-Derivatetransaktionen entgegengenommen wurden, in Geldmarktfonds reinvestiert. Nicht in bar hinterlegte Sicherheiten, die mittels Vollrechtsübertragungen in Bezug auf OTC-Derivatetransaktionen entgegengenommen wurden, können nicht verkauft, reinvestiert oder verpfändet werden. Erlöse, welche die Fonds aus der Reinvestition von Barsicherheiten in Geldmarktfonds erwirtschafteten, beliefen sich netto vor an den entsprechenden Kontrahenten zahlbaren Zinsen auf 5.826.077 US\$ für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (30. Juni 2022: 207.068 US\$) und werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

Die Anlageverwalter wenden interne Verfahren an, um die Kreditwürdigkeit eines Kontrahenten gemäß den OGAW-Anforderungen der Zentralbank zu ermitteln und festzustellen, ob die OTC-Swaps unter dem International Swaps and Derivatives Association Master Agreement („ISDA“) oder zusätzlichen Bestätigungsvereinbarungen nach Branchenstandard emittiert werden.

Zum 30. Juni 2023 halten die Fonds mit synthetischer Nachbildung OTC-Swaps von den Emittenten Barclays Bank Plc und Merrill Lynch International. Zum 30. Juni 2022 halten die Fonds mit synthetischer Nachbildung OTC-Swaps von den Emittenten Barclays Bank Plc, Citigroup Global Markets Limited und Merrill Lynch International. Kontrahenten aller umgekehrten Pensionsgeschäfte, die die Gesellschaft für die Fonds mit synthetischer Nachbildung eingegangen ist, sind Barclays Bank Plc und Merrill Lynch International.

Zusätzlich zu den von den Anlageverwaltern im Rahmen der täglichen Überwachung von Transaktionen mit den Kontrahenten eingesetzten Verfahren prüfen die Anlageverwalter fortlaufend die Liste der Kontrahenten, um sicherzustellen, dass keine wesentlichen Probleme vorliegen, die die Fähigkeit der Kontrahenten zur Erfüllung ihrer Verpflichtungen beeinträchtigen könnten.

Das langfristige Kredit-Rating von S&P für die Barclays Bank Plc zum 30. Juni 2022 ist A+ (30. Juni 2022: A), für Citigroup Global Markets Limited ist A+ (30. Juni 2022: A+) und für Merrill Lynch International ist A+ (30. Juni 2022: A+).

Im Wesentlichen werden alle in den Fonds gehaltenen liquiden Mittel und Wertpapiere über die Verwahrstelle gehalten. The Bank of New York Mellon SA/NV hat zum 30. Juni 2022 ein langfristiges Emittenten-Kreditrating von S&P von AA- (30. Juni 2021: AA-).

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

C. Kreditrisiko (Fortsetzung)

(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023 hielten die Fonds Einschusszahlungen, Barbestände, Geldmarktinstrumente, umgekehrte Pensionsgeschäfte bzw. OTC-Swaps wie nachstehend angegeben:

OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte	Bank of New York Mellon 30. Juni 2023	% des Nettovermögens	Merrill Lynch International 30. Juni 2023	% des Nettovermögens	Citigroup Global Markets Limited 30. Juni 2023	% des Nettovermögens	Barclays Bank Plc 30. Juni 2023	% des Nettovermögens
Gesellschaft insgesamt	153.857.246 \$	1 %	154.010.011 \$	1 %	-	-	2.051.473.687 \$	14 %

Zum 30. Juni 2022 hielten die Fonds Einschusszahlungen, Barbestände, Geldmarktinstrumente, umgekehrte Pensionsgeschäfte bzw. OTC-Swaps wie nachstehend angegeben:

OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte	Bank of New York Mellon 30. Juni 2022	% des Nettovermögens	Merrill Lynch International 30. Juni 2022	% des Nettovermögens	Citigroup Global Markets Limited 30. Juni 2022	% des Nettovermögens	Barclays Bank Plc 30. Juni 2022	% des Nettovermögens
Gesellschaft insgesamt	149.444.522 \$	1 %	98.891.208 \$	1 %	28.516.411 \$	0 %	1.465.649.316 \$	12 %

(ii) Transaktionen mit autorisierten Teilnehmern

Das aus Zeichnungen und Rücknahmen mit autorisierten Teilnehmern resultierende Kreditrisiko bezieht sich auf das mit der Abrechnung von Transaktionen verbundene Risiko. Für den Fall, dass (i) ein autorisierter Teilnehmer in Bezug auf eine Barzeichnung nicht innerhalb der im jeweiligen Prospektnachtrag angegebenen Abwicklungszeit die erforderlichen Barmittel liefert oder (ii) in Bezug auf eine Barzeichnung, die zu einer gezielten Transaktion führt, ein autorisierter Teilnehmer nicht innerhalb der im jeweiligen Prospektnachtrag festgelegten Abwicklungszeit die erforderlichen Barmittel liefert oder der autorisierte designierte Makler die betreffenden Basiswerte (oder einen Teil davon) nicht innerhalb der von der Verwaltungsgesellschaft (oder den von ihr ernannten Delegierten) festgelegten Abwicklungszeit an die Gesellschaft überträgt, behält sich die Gesellschaft und/oder die Verwaltungsgesellschaft (oder ihr ernannter Delegierter) das Recht vor, den betreffenden Zeichnungsantrag zu stornieren.

(iii) Kontrahentenrisiko im Zusammenhang mit der Zahlstelle – Dividenden und Liquidationsgelder von Fonds

Die Zahlstelle für die Fonds ist dafür zuständig, an den jeweiligen Zahlungsterminen die Zahlungen an Teilnehmer in Bezug auf Dividendengelder und die Erlöse von Zwangsrücknahmen von ETF-Anteilen zu veranlassen.

Vor dem Dividendenzahlungstermin werden die für die an die Teilnehmer zur Ausschüttung als Dividenden bestimmten Gelder von den Barkonten der Gesellschaft bei der Verwahrstelle an die Zahlstelle überwiesen. In der Zwischenzeit werden die Dividendenerträge von der Zahlstelle (oder ihrer angeschlossenen Depotbank) in Form von Barmitteln gehalten, und die Gesellschaft ist in Bezug auf diese Barmittel gegenüber der Zahlstelle und ihrer angeschlossenen Depotbank einem Kreditrisiko ausgesetzt. Bei der Zahlstelle gehaltene Barmittel werden in der Praxis nicht getrennt geführt, sondern stellen Verbindlichkeiten der Zahlstelle (oder ihrer angeschlossenen Depotbank) gegenüber der Gesellschaft als Einleger dar. Im Fall der Insolvenz der Zahlstelle (oder ihrer angeschlossenen Depotbank) wird die Gesellschaft in der Zwischenzeit in Bezug auf die Barmittel als allgemeiner, nicht bevorrechtigter Gläubiger der Zahlstelle (oder ihrer angeschlossenen Depotbank) behandelt. Die Gesellschaft kann auf Schwierigkeiten stoßen und/oder Verzögerungen bei der Beitreibung dieser Verbindlichkeit erleiden oder ist womöglich nicht in der Lage, sie vollständig oder überhaupt beizutreiben, wobei die Gesellschaft in diesem Fall einen Teil oder alle Dividendengelder verlieren kann, die von der Zahlstelle ausgeschüttet werden, was zu einer Reduzierung im Wert eines Fonds führt.

Für alle Fonds mit synthetischer Nachbildung ist das Risiko im Zusammenhang mit nicht abgerechneten Transaktionen begrenzt, denn in den jeweiligen Abrechnungssystemen werden Zeichnungen und Rücknahmen ausnahmslos auf der Basis „Lieferung-gegen-Zahlung“ abgerechnet.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

D. Liquiditätsrisiko

Das Liquiditätsrisiko ist das Risiko, dass die Gesellschaft in Schwierigkeiten gerät, ihren Verpflichtungen im Zusammenhang mit finanziellen Verbindlichkeiten nachzukommen. Das größte Liquiditätsrisiko der Gesellschaft ergibt sich aus den Rücknahmeanträgen von Anlegern (im Falle der Gesellschaft die autorisierten Teilnehmer). Die Anteilhaber der Gesellschaft können ihre Anteile an jedem Geschäftstag gegen eine Barzahlung in Höhe des Anteils am NIW des jeweiligen Fonds zurückgeben. Daher ist die Gesellschaft dem Liquiditätsrisiko ausgesetzt, die täglichen Rücknahmeanträge ihrer Anteilhaber auszuführen.

Die Fonds ermöglichen die Zeichnung und Rückgabe von Anteilen und sind daher einem Liquiditätsrisiko im Zusammenhang mit Rückgaben durch Anteilhaber gemäß den Bestimmungen des Verkaufsprospekts ausgesetzt. Diese Bestimmungen schließen die Möglichkeit ein, Rücknahmedividenden in bar oder Sachleistungen zu zahlen oder Rücknahmen an jeweils einem Handelstag auf 10 % des NIW des jeweiligen Fonds zu beschränken. Die Portfolios werden so verwaltet, dass ausreichend liquide Anlagen vorhanden sind, um den normalen Liquiditätsbedarf zu decken. Bei Anteilsrücknahmen in größerem Umfang kann es jedoch erforderlich werden, dass die Fonds ihre Anlagen schneller liquidieren als wünschenswert, um liquide Mittel für Rücknahmen zu beschaffen. Diese Faktoren können sich negativ auf den Wert der zurückgenommenen Anteile und die Bewertung der noch umlaufenden Anteile auswirken sowie auf die Liquidität der verbleibenden Anteile, wenn die liquideren Vermögenswerte verkauft wurden, um die Rücknahmen durchzuführen.

Die Gesellschaft kann die Berechnung des NIW und die Zeichnung und Rücknahme von Anteilen eines oder mehrerer Fonds unter bestimmten Umständen aussetzen.

Der Verwaltungsrat kann vorbehaltlich der Regeln maßgeblicher zentraler Abwicklungssysteme und/oder der Regeln einer maßgeblichen Börsen eine zeitweilige Aussetzung der Bestimmung des NIW von bestimmten Klassen und der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen jedweder Klassen beschließen:

- I. während der gesamten Dauer oder Teilen eines Zeitraums, in dem einer der Hauptmärkte, an dem ein wesentlicher Teil der Werte des Index, auf den sich der betreffende Fonds oder die Anlagen des betreffenden Fonds beziehen, notiert oder gelistet ist oder gehandelt wird, oder eines Zeitraums, in dem die Devisenmärkte für die Basiswährung des Fonds oder die Währung, auf die ein wesentlicher Teil der Titel des Index, auf den sich der betreffende Fonds oder die Anlagen des betreffenden Fonds beziehen, lauten, geschlossen sind (außer während der üblichen Schließungszeiten an Wochenenden oder normalen Feiertagen) oder eines Zeitraums, während dessen der dortige Handel eingeschränkt oder ausgesetzt ist oder der Handel an einer Terminbörse oder einem relevanten Terminmarkt ausgesetzt ist;
- II. während der gesamten Dauer oder Teilen eines Zeitraums, in dem aufgrund politischer, wirtschaftlicher, militärischer oder währungsbezogener Ereignisse oder anderer Umstände, die nicht dem Einfluss, der Verantwortung oder der Macht des Verwaltungsrats unterliegen, eine Veräußerung oder Bewertung von Anlagen des betreffenden Fonds nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht ohne Nachteile für die Interessen der Anteilhaber im Allgemeinen oder der Inhaber von Anteilen des betreffenden Fonds in angemessener Weise durchführbar ist, oder falls der NIW nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht in angemessener Weise berechnet werden kann oder die Veräußerung erhebliche Nachteile für die Anteilhaber im Allgemeinen oder die Inhaber von Anteile des betreffenden Fonds zur Folge hätte;
- III. während der gesamten Dauer oder in Teilen eines Zeitraums, in dem die normalerweise für die Ermittlung des Werts einer der Anlagen der Gesellschaft verwendeten Kommunikationsmittel ausfallen, oder in dem aus irgendeinem Grund der Wert einer der Anlagen oder anderen Vermögenswerte des betreffenden Fonds nicht in angemessener oder gerechtfertigter Weise festgestellt werden kann;

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

D. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

- IV. während der gesamten Dauer oder in Teilen eines Zeitraums, in dem die Gesellschaft nicht in der Lage ist, Gelder zurückzuführen, die für Rücknahmezahlungen erforderlich sind, oder in dem solche Zahlungen nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht zu normalen Preisen oder normalen Wechselkursen durchgeführt werden können, oder in dem bei der Übertragung von Geldern oder Vermögenswerten, die für Zeichnungen, Rücknahmen oder Handelsgeschäfte erforderlich sind, Probleme bestehen oder voraussichtlich auftreten werden;
- V. nach Ermessen des Verwaltungsrats unter Umständen, unter denen der Verwaltungsrat eine solche Aussetzung als im besten Interesse der Gesellschaft oder des Fonds oder der Anleger des Fonds insgesamt betrachtet;
- VI. nach Veröffentlichung einer Bekanntmachung zur Einberufung einer Hauptversammlung von Anteilhabern, auf der die Abwicklung der Gesellschaft oder die Schließung eines Fonds beschlossen werden soll;
- VII. wenn der Handel mit den Anteilen an einer relevanten Börse, an der sie notiert sind, eingeschränkt oder ausgesetzt wird;
- VIII. wenn die Abwicklung oder Abrechnung von Wertpapieren in einem anerkannten Clearing- und Abrechnungssystem unterbrochen ist;
- IX. in einem Zeitraum, in dem der Handel mit Anteilen aufgrund einer Verfügung oder Anordnung einer zuständigen Regulierungsbehörde ausgesetzt ist;
- X. in jedem Zeitraum, in dem ein Index nicht zusammengestellt oder veröffentlicht wird.

Der Zentralbank und den relevanten Börsen wird unverzüglich (und in jedem Fall während der Geschäftstage, an dem die Aussetzung erfolgt/endet) eine Benachrichtigung über Anfang und Ende eines Aussetzungszeitraums erteilt und soweit gesetzlich vorgeschrieben oder in der Praxis des betreffenden Landes üblich, auch weiteren zuständigen Behörden in einem Mitgliedstaat oder anderem Land, in dem die Anteile zum Vertrieb registriert sind. Diese Mitteilung ist auch in derjenigen bzw. denjenigen Publikation(en) zu veröffentlichen, die vom Verwaltungsrat bestimmt werden kann/ können, und ist in jedem Fall über die Medien zu kommunizieren, über die Anteilspreise veröffentlicht werden.

Ferner werden die Personen benachrichtigt, die Zeichnungs- oder Rücknahmeanträge für Anteile des/der betreffenden Fonds stellen. Sämtliche Zeichnungs- oder Rücknahmeanträge für Anteile, die während eines Aussetzungszeitraums eingehen, werden normalerweise auf den nächsten Handelstag verschoben.

Die Gesellschaft wird, sofern möglich, alle erforderlichen Schritte unternehmen, um eine Aussetzung so bald wie möglich zu beenden.

Falls die Gesamtzahl der Rücknahmeanträge an einem Handelstag in Bezug auf einen Fonds 10 % oder mehr des NIW dieses Fonds beträgt, kann jeder Rücknahmeantrag für Anteile dieses Fonds nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft soweit reduziert werden, dass die Gesamtzahl der zurückzunehmenden Anteile dieses Fonds an diesem Handelstag 10 % des NIW dieses Fonds nicht übersteigt. Jeder Teil eines Antrags auf Rücknahme, der infolge der Ausübung dieses Rechts durch die Verwaltungsgesellschaft nicht bearbeitet wurde, wird so behandelt, als ob ein auf den nächsten und jeden nachfolgenden Handelstag bezogener Antrag gestellt wurde (für die dasselbe Recht der Verwaltungsgesellschaft gilt), bis die ursprünglichen Anträge vollständig erfüllt worden sind.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

D. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Während einer solchen Aussetzung kann es für Anleger schwierig werden, Anteile auf dem Sekundärmarkt zu kaufen oder zu verkaufen, und der Sekundärmarktpreis entspricht gegebenenfalls nicht dem NIW je Anteil. Falls die Gesellschaft die Zeichnung und/oder Rücknahme von Anteilen eines Fonds aussetzen muss oder eine Börse, an der die Anlagen eines Fonds gehandelt werden, geschlossen wird, ist damit zu rechnen, dass Abschläge oder Aufschläge in größerem Umfang entstehen können.

Sämtliche Verbindlichkeiten zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 sind in weniger als einem Monat fällig.

Bei OTC-Swaps stellen die Werte in der Bilanz den beizulegenden Zeitwert für das aktuelle und vorangegangene Geschäftsjahr dar. Zum Zeitpunkt der Zahlung könnte sich der beizulegende Zeitwert aufgrund von Marktbewegungen ändern. Die Nennwerte dieser OTC-Swaps werden in der Aufstellungen der Vermögenswerte ausgewiesen.

Cybersicherheit

Die Verwaltungsgesellschaft pflegt einen Rahmen für Cyber- und Informationssicherheit und verbessert diesen ständig, und stellt so die Integrität unserer Geschäftstätigkeit sowie die Vertraulichkeit der Informationen sicher. Dieser besteht aus einer allgemeinen Informationssicherheitsstrategie, einer Reihe an Richtlinien, Standards und Kontrollen, die im Rahmen des LGIM-Verwaltungsrahmen laufen. Zuständigkeiten für die Informationssicherheit werden im Unternehmen aufgeteilt, unterstützt von Spezialistenteams, Schulungen, Bewusstseinskampagnen und Sicherheitskontrollen.

4. Zeitwert

Die Bilanzierungsgrundsätze der Gesellschaft zur Bewertung zum beizulegenden Zeitwert schreiben eine Zeitwerthierarchie vor, wenn Finanzinstrumente zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden, die auf folgenden Ebenen basiert:

Ebene 1 – nicht adjustierte, an aktiven Märkten notierte Preise für identische, unbeschränkte Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, zu denen die Gesellschaft am Bewertungstag Zugang hat;

Ebene 2 – Bewertungsparameter, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (d. h. als Preise) oder indirekt (d. h. abgeleitet aus Preisen) beobachtbar sind und die nicht der Ebene 1 angehören; und

Ebene 3 – Bewertungsparameter für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (d. h. nicht beobachtbare Parameter).

Die Ebene in der Zeitwerthierarchie, welcher der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments in seiner Gesamtheit zugeordnet wird, wird anhand des niedrigsten Bewertungsparameters festgelegt, der für die Zeitwertbewertung maßgeblich ist. Zu diesem Zweck wird die Signifikanz eines Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Werden bei einer Zeitwertbewertung beobachtbare Parameter verwendet, die aufgrund von nicht beobachtbaren Parametern eine maßgebliche Anpassung erfordern, so wird diese Zeitwertbewertung als der Ebene 3 zuzuordnend erachtet. Die Beurteilung der Signifikanz eines Parameters für die Zeitwertbewertung eines Finanzinstruments in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Berücksichtigung spezifischer Faktoren des jeweiligen Vermögenswerts bzw. der jeweiligen Verbindlichkeit.

Die Finanzinstrumente, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind kurzfristige finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, deren Buchwerte in etwa dem beizulegenden Zeitwert entsprechen. Dazu gehören unter anderem:

(i) Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente und Forderungen und Verbindlichkeiten gegenüber Maklern. Dabei handelt es sich um kurzfristige finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, deren Buchwerte aufgrund ihrer Kurzfristigkeit und der hohen Bonität der Geschäftspartner dem beizulegenden Zeitwert entsprechen. Die Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente und Forderungen und Verbindlichkeiten gegenüber Maklern werden auf Ebene 2 der Zeitwerthierarchie eingestuft; und

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

(ii) Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen Der Fonds nimmt die rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile routinemäßig zu einem Betrag in Höhe des anteiligen Nettovermögens des Fonds zum Zeitpunkt der Rücknahme zurück bzw. gibt sie zu einem entsprechenden Betrag aus, berechnet auf einer Grundlage, die mit der in diesem Abschluss verwendeten Grundlage vereinbar ist. Dementsprechend entspricht der Buchwert des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens annähernd ihrem beizulegenden Zeitwert. Die Anteile sind Ebene 1 der Zeitwerthierarchie zugeordnet.

Die Barbestände der Gesellschaft können in verzinsliche, kurzfristige Geldmarkt-Investmentfonds mit AAA-Rating umgeschichtet werden, die in der Bilanz der Gesellschaft als Geldmarktinstrumente klassifiziert werden. Diese Geldmarktinstrumente werden für die Gesellschaft im Namen der The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, der Verwahrstelle, gehalten. Zum 30. Juni 2023 hielt kein Fonds mehr als 3,01 %* (30. Juni 2022: 173 %*) seines Nettovermögens in Kassenbeständen.

* In diesen Beträgen sind als Sicherheiten gehaltene Barmittel nicht eingeschlossen.

Die folgende Tabelle zeigt die Analyse der zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesenen finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten nach den vorstehend beschriebenen drei Ebenen:

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

30. Juni 2023	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Gesellschaft insgesamt	\$				
Geldmarktinstrumente		152.846.305	–	–	152.846.305
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	564.944	–	564.944
Stammaktien		10.459.810.426	1.183.314	953.712	10.461.947.452
Vorzugsaktien		41.198.989	–	–	41.198.989
Bezugsrechte		986	–	–	986
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten		–	9.153.254	–	9.153.254
Unternehmensanleihen		–	1.080.504.770	–	1.080.504.770
Staatsanleihe		145.422.317	771.728.523	–	917.150.840
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	2.180.846.608	–	2.180.846.608
		10.799.279.023	4.043.981.413	953.712	14.844.214.148

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2023	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	\$				
Geldmarktinstrumente		20.064.103	–	–	20.064.103
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	426.422.859	–	426.422.859
		20.064.103	426.422.859	–	446.486.962
L&G Gold Mining UCITS ETF	\$				
Stammaktien		129.923.429	–	–	129.923.429
		129.923.429	–	–	129.923.429
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	\$				
Geldmarktinstrumente		2.895.109	–	–	2.895.109
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	192.143	–	192.143
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	30.889.828	–	30.889.828
		2.895.109	31.081.971	–	33.977.080
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	\$				
Stammaktien		1.042.273.681	–	–	1.042.273.681
		1.042.273.681	–	–	1.042.273.681

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2023	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Cyber Security UCITS ETF	\$				
Stammaktien		2.519.706.263	–	–	2.519.706.263
		2.519.706.263	–	–	2.519.706.263
L&G Battery Value–Chain UCITS ETF	\$				
Stammaktien		1.007.491.568	–	–	1.007.491.568
Vorzugsaktien		33.735.158	–	–	33.735.158
		1.041.226.726	–	–	1.041.226.726
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	\$				
Stammaktien		46.423.205	–	–	46.423.205
		46.423.205	–	–	46.423.205
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	\$				
Stammaktien		254.116.510	–	–	254.116.510
		254.116.510	–	–	254.116.510

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2023	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Clean Water UCITS ETF	\$				
Stammaktien		443.086.775	–	–	443.086.775
		443.086.775	–	–	443.086.775
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	\$				
Stammaktien		410.454.058	–	–	410.454.058
		410.454.058	–	–	410.454.058
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	\$				
Stammaktien		123.319.062	–	–	123.319.062
		123.319.062	–	–	123.319.062
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF¹	€				
Stammaktien		392.572.471	230.951	–	392.803.422
Vorzugsaktien		1.585.846	–	–	1.585.846
Bezugsrechte		751	–	–	751
		394.159.068	230.951	–	394.390.019
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF¹	\$				
Stammaktien		1.353.811.782	–	–	1.353.811.782
		1.353.811.782	–	–	1.353.811.782

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2023	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Clean Energy UCITS ETF	\$				
Stammaktien		212.273.792	–	947.407	213.221.199
		212.273.792	–	947.407	213.221.199
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	£				
Unternehmensanleihen		–	93.492.345	–	93.492.345
		–	93.492.345	–	93.492.345
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	£				
Unternehmensanleihen		–	104.780.799	–	104.780.799
		–	104.780.799	–	104.780.799
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten		–	1.126.940	–	1.126.940
Unternehmensanleihen		–	27.539.383	–	27.539.383
Staatsanleihe		–	238.659.815	–	238.659.815
		–	267.326.138	–	267.326.138
L&G China CNY Bond UCITS ETF²	\$				
Staatsanleihe		–	136.416.652	–	136.416.652
		–	136.416.652	–	136.416.652
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	\$				
Unternehmensanleihen		–	120.871.795	–	120.871.795
		–	120.871.795	–	120.871.795
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten		–	8.026.314	–	8.026.314
Unternehmensanleihen		–	680.019.030	–	680.019.030
Staatsanleihe		–	15.585.118	–	15.585.118
		–	703.630.462	–	703.630.462
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	\$				
Stammaktien		531.958.563	–	–	531.958.563
		531.958.563	–	–	531.958.563

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2023	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	€				
Stammaktien		28.201.772	271.391	–	28.473.163
Vorzugsaktien		621.786	–	–	621.786
		28.823.558	271.391	–	29.094.949
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	\$				
Stammaktien		19.994.705	–	–	19.994.705
Vorzugsaktien		1.244.325	–	–	1.244.325
		21.239.030	–	–	21.239.030
L&G Digital Payments UCITS ETF	\$				
Stammaktien		23.186.855	–	–	23.186.855
		23.186.855	–	–	23.186.855
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	\$				
Geldmarktinstrumente		118.468.861	–	–	118.468.861
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	1.544.114.955	–	1.544.114.955
		118.468.861	1.544.114.955	–	1.662.583.816
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	\$				
Stammaktien		16.702.536	338.386	–	17.040.922
Vorzugsaktien		565.391	–	–	565.391
		17.267.927	338.386	–	17.606.313
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	\$				
Staatsanleihe		–	381.066.938	–	381.066.938
		–	381.066.938	–	381.066.938
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF³	\$				
Stammaktien		3.684.000	–	–	3.684.000
		3.684.000	–	–	3.684.000
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF⁴	\$				
Stammaktien		3.773.234	–	–	3.773.234
Vorzugsaktien		21.326	–	–	21.326
		3.794.560	–	–	3.794.560
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF⁴	\$				
Stammaktien		2.611.262	–	–	2.611.262
		2.611.262	–	–	2.611.262
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF⁴	\$				
Stammaktien		7.796.286	–	–	7.796.286
		7.796.286	–	–	7.796.286

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2023	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF⁵	\$				
Stammaktien		3.860.417	–	–	3.860.417
		3.860.417	–	–	3.860.417
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF⁵	\$				
Stammaktien		4.166.432	–	–	4.166.432
		4.166.432	–	–	4.166.432
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF⁶	\$				
Stammaktien		15.046.915	–	–	15.046.915
Vorzugsaktien		118.683	–	–	118.683
Bezugsrechte		167	–	–	167
		15.165.765	–	–	15.165.765

²Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

³Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

⁴Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

⁵Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

⁶Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

30. Juni 2022	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Gesellschaft insgesamt	\$				
Geldmarktinstrumente		148.140.910	–	–	148.140.910
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	3.319.246	–	3.319.246
Stammaktien		8.143.453.959	–	–	8.143.453.959
Vorzugsaktien		33.095.078	–	–	33.095.078
Bezugsrechte		83.399	–	–	83.399
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten		–	384.255	–	384.255
Unternehmensanleihen		–	1.231.088.242	–	1.231.088.242
Staatsanleihe		–	638.424.551	–	638.424.551
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	1.649.707.629	–	1.649.707.629
		8.324.773.346	3.522.923.923	–	11.847.697.269

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2022	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	\$				
Geldmarktinstrumente		49.574.992	–	–	49.574.992
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	623.438.724	–	623.438.724
		49.574.992	623.438.724	–	673.013.716
L&G Gold Mining UCITS ETF	\$				
Stammaktien		126.762.821	–	–	126.762.821
		126.762.821	–	–	126.762.821
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	\$				
Geldmarktinstrumente		2.341.426	–	–	2.341.426
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	29.294.923	–	29.294.923
		2.341.426	29.294.923	–	31.636.349
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	\$				
Stammaktien		801.566.570	–	–	801.566.570
		801.566.570	–	–	801.566.570

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2022	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Cyber Security UCITS ETF	\$				
Stammaktien		2.467.615.921	–	–	2.467.615.921
		2.467.615.921	–	–	2.467.615.921
L&G Battery Value–Chain UCITS ETF	\$				
Stammaktien		743.728.921	–	–	743.728.921
Vorzugsaktien		28.658.071	–	–	28.658.071
		772.386.992	–	–	772.386.992
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	\$				
Stammaktien		33.895.308	–	–	33.895.308
		33.895.308	–	–	33.895.308
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	\$				
Stammaktien		262.471.950	–	–	262.471.950
		262.471.950	–	–	262.471.950

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2022	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Clean Water UCITS ETF	\$				
Stammaktien		307.702.167	–	–	307.702.167
		307.702.167	–	–	307.702.167
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	\$				
Stammaktien		223.201.822	–	–	223.201.822
		223.201.822	–	–	223.201.822
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	\$				
Stammaktien		125.029.978	–	–	125.029.978
		125.029.978	–	–	125.029.978
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF¹	€				
Stammaktien		91.734.309	–	–	91.734.309
Vorzugsaktien		211.639	–	–	211.639
		91.945.948	–	–	91.945.948
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF¹	\$				
Stammaktien		858.878.729	–	–	858.878.729
		858.878.729	–	–	858.878.729

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2022	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Clean Energy UCITS ETF	\$				
Stammaktien		175.089.299	–	–	175.089.299
Bezugsrechte		83.334	–	–	83.334
		175.172.633	–	–	175.172.633
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	£				
Unternehmensanleihen		–	68.259.120	–	68.259.120
		–	68.259.120	–	68.259.120
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	£				
Unternehmensanleihen		–	82.924.022	–	82.924.022
		–	82.924.022	–	82.924.022
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten		–	3.203	–	3.203
Unternehmensanleihen		–	13.791.337	–	13.791.337
Staatsanleihe		–	64.543.497	–	64.543.497
		–	78.338.037	–	78.338.037
L&G China CNY Bond UCITS ETF²	\$				
Staatsanleihe		–	255.069.539	–	255.069.539
		–	255.069.539	–	255.069.539
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	\$				
Unternehmensanleihen		–	90.144.147	–	90.144.147
		–	90.144.147	–	90.144.147
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten		–	381.052	–	381.052
Unternehmensanleihen		–	937.925.050	–	937.925.050
Staatsanleihe		–	12.930.976	–	12.930.976
		–	951.237.078	–	951.237.078
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	\$				
Stammaktien		495.194.006	–	–	495.194.006
		495.194.006	–	–	495.194.006
L&G ESG Green Bond UCITS ETF	€				
Unternehmensanleihen		–	5.350.143	–	5.350.143
Staatsanleihe		–	2.763.890	–	2.763.890
		–	8.114.033	–	8.114.033

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2022	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	€				
Stammaktien		20.659.302	–	–	20.659.302
Vorzugsaktien		576.330	–	–	576.330
		21.235.632	–	–	21.235.632
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	\$				
Stammaktien		19.988.531	–	–	19.988.531
Vorzugsaktien		991.608	–	–	991.608
		20.980.139	–	–	20.980.139
L&G Digital Payments UCITS ETF	\$				
Stammaktien		11.538.881	–	–	11.538.881
		11.538.881	–	–	11.538.881
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	\$				
Geldmarktinstrumente		80.360.375	–	–	80.360.375
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	795.902.955	–	795.902.955
		80.360.375	795.902.955	–	876.263.330
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	\$				
Stammaktien		15.086.890	–	–	15.086.890
Vorzugsaktien		537.134	–	–	537.134
		15.624.024	–	–	15.624.024
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	\$				
Staatsanleihe		–	276.814.385	–	276.814.385
		–	276.814.385	–	276.814.385

²Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

30. Juni 2023	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Gesellschaft insgesamt	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(64.404.885)	–	(64.404.885)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten		–	(459.208)	–	(459.208)
		–	(64.864.093)	–	(64.864.093)
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(9.243.839)	–	(9.243.839)
		–	(9.243.839)	–	(9.243.839)
		–	(1.169.730)	–	(1.169.730)
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten		–	(458.961)	–	(458.961)
		–	(458.961)	–	(458.961)
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(53.399.628)	–	(53.399.628)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten		–	(247)	–	(247)
		–	(53.399.875)	–	(53.399.875)

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2022	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Gesellschaft insgesamt	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(112.121.180)	–	(112.121.180)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten		–	(8.317.825)	–	(8.317.825)
		–	(120.439.005)	–	(120.439.005)
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(44.009.038)	–	(44.009.038)
		–	(44.009.038)	–	(44.009.038)
		–	(202.833)	–	(202.833)
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(869.132)	–	(869.132)
		–	(869.132)	–	(869.132)
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten		–	(230.420)	–	(230.420)
		–	(230.420)	–	(230.420)
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten		–	(8.087.405)	–	(8.087.405)
		–	(8.087.405)	–	(8.087.405)
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(57.878.638)	–	(57.878.638)
		–	(57.878.638)	–	(57.878.638)

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Vergleiche der Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts von Finanzanlagen der Ebene 3 zwischen dem Beginn und dem Ende des Geschäftsjahres erfolgen nachstehend. Bei der Ermittlung der Höhe von Übertragungen in und aus Ebenen der Zeitwerthierarchie wird davon ausgegangen, dass die Übertragungen zu Beginn des Geschäftsjahres erfolgt sind.

L&G Clean Energy UCITS ETF 30. Juni 2023	Stammaktien €	Gesamt €
Anfangsbestand	-	-
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	-	-
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	5.985.790	5.985.790
Verkäufe	-	-
Realisierter Verlust	-	-
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(5.038.383)	(5.038.383)
Schlussbestand	947.407	947.407

L&G Hydrogen Economy UCITS ETF 30. Juni 2023	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	-	-
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	971.336	971.336
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	55.045	55.045
Verkäufe	(15.055)	(15.055)
Realisierter Verlust	(81.910)	(81.910)
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(929.416)	(929.416)
Schlussbestand	-	-

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Vergleiche der Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts von Finanzanlagen der Ebene 3 für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 erfolgen nachstehend.

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹ 30. Juni 2022	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	-	-
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	-	-
Verkäufe	-	-
Realisierter Verlust	-	-
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	-	-
Schlussbestand	-	-

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF 30. Juni 2022	Stammaktien €	Gesamt €
Anfangsbestand	-	-
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	3.605.562	3.605.562
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	1.993.236	1.993.236
Verkäufe	(795.121)	(795.121)
Realisierter Gewinn	61.690	61.690
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(4.865.367)	(4.865.367)
Schlussbestand	-	-

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

L&G Digital Payments UCITS ETF 30. Juni 2022	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	-	-
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	137.876	137.876
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	287.903	287.903
Verkäufe	(12.934)	(12.934)
Realisierter Verlust	(4.793)	(4.793)
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(408.052)	(408.052)
Schlussbestand	-	-

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF 30. Juni 2022	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	-	-
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	-	-
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	1.470.506	1.470.506
Verkäufe	(391.909)	(391.909)
Realisierter Verlust	(12.830)	(12.830)
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(1.065.767)	(1.065.767)
Schlussbestand	-	-

Alle realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste sind in der Gesamtergebnisrechnung offengelegt.

Osteuropa

Am 24. Februar 2022 startete Russland eine groß angelegte Invasion der Ukraine, die geopolitische und wirtschaftliche Unsicherheit in der globalen Wirtschaft und auf Finanzmärkten auslöste. Infolgedessen wurden von vielen Ländern Wirtschaftssanktionen erhoben. Der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF, L&G Artificial Intelligence UCITS ETF und L&G Digital Payments UCITS ETF haben ein direktes und indirektes Engagement in Russland durch Anlagen in Stammaktien, Vorzugsaktien und ADRs.

Die Verwaltungsgesellschaft hat die folgenden Richtlinien zur Zeitwertbewertung in Bezug auf den Veräußerungswert von in den Fonds der Gesellschaft gegebenenfalls gehaltener russischer Wertpapiere umgesetzt:

Art der Anlage:

- Aktien: null Wert
- ADRs/GDRs: null Wert
- Lokalwährungsanleihen: null Wert
- Nicht auf Lokalwährungen lautende Anleihen: Marktwert gemäß beobachtbarer Parameter

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Osteuropa (Fortsetzung)

In der nachstehenden Tabelle sind der beizulegende Zeitwert und die prozentuale (%) Auswirkung auf das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens in Bezug auf das Engagement in russischen Wertpapieren zum 30. Juni 2023 aufgeführt:

Fonds	Art der Anlage	Ebene	Zeitwert (USD)	% Auswirkung auf das Nettovermögen
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	Aktien	3	null	null
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	Aktien	3	null	null
L&G Digital Payments UCITS ETF	ADR's	3	null	null

In der nachstehenden Tabelle sind der beizulegende Zeitwert und die prozentuale (%) Auswirkung auf das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens in Bezug auf das Engagement in russischen Wertpapieren zum 30. Juni 2022 aufgeführt:

Fonds	Art der Anlage	Ebene	Zeitwert (USD)	% Auswirkung auf das Nettovermögen
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	Aktien	3	null	0,81
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	Aktien	3	null	0,59
L&G Digital Payments UCITS ETF	ADR's	3	null	2,11

Prozentuale Auswirkung auf das Nettovermögen, ermittelt anhand des Marktwertes der Wertpapiere vor Anwendung der o.g. Richtlinien zur Zeitwertbewertung für Engagements in russischen Wertpapieren.

Da die restlichen Fonds der Gesellschaft kein direktes oder indirektes Engagement in Russland haben, ist der Verwaltungsrat der Auffassung, dass die Entwicklungen in Osteuropa und daraus resultierende Sanktionen wahrscheinlich keine wesentliche direkte oder indirekte Auswirkung auf diese Fonds haben werden. Der Verwaltungsrat überwacht weiterhin die Entwicklungen in Osteuropa sowie alle potenziellen direkten oder indirekten wirtschaftlichen Auswirkungen auf die Fonds der Gesellschaft auf kontinuierlicher Basis.

Wertpapiere der Ebene 3

Zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 wurden Wertpapiere der Ebene 3 gehalten, deren Handel vor dem Bilanzstichtag ausgesetzt wurde. Das Ziel der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert bleibt jedoch dasselbe, d. h. ein Ausstiegspreis aus der Perspektive eines Marktteilnehmers, der den Vermögenswert hält oder die Verbindlichkeit schuldet. Bei keinem der ausgesetzten Wertpapiere gibt es nach Beurteilung seitens der kompetenten Person Hinweise darauf, dass der zuletzt gehandelte Kurs angepasst werden sollte, somit bleibt der zuletzt gehandelte Kurs der beste Maßstab für den beizulegenden Zeitwert der ausgesetzten Wertpapiere. Da die Beurteilung seitens der kompetenten Person zur Ermittlung eines angemessenen Zeitwerts für die ausgesetzten Wertpapiere eingesetzt wird, gilt dies als signifikanter nicht beobachtbarer Parameter.

Für den L&G ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF, den L&G Artificial Intelligence UCITS ETF, den L&G Digital Payments UCITS ETF und den L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF wurden zum 30. Juni 2023 Wertpapiere der Ebene 3 zum beizulegenden Zeitwert von null erfasst.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Wertpapiere der Ebene 3 (Fortsetzung)

Für den L&G ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF¹, den L&G Artificial Intelligence UCITS ETF, den L&G Digital Payments UCITS ETF und den L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere der Ebene 3 zum beizulegenden Zeitwert von null erfasst.

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 fanden Übertragungen von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten zwischen den verschiedenen Ebenen der Zeitwerthierarchie statt. Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 2 sind das Ergebnis von anderen Parametern als notierten Preisen. Zum 30. Juni 2023 wurden Positionen in Stammaktien von Ebene 1 in Ebene 2 im L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF und L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF mit einem Gesamtwert von 1.378.988 US\$ übertragen (30. Juni 2022: null).

Die Übertragungen von Ebene 1 in die Ebene 3 sind das Ergebnis von Handelsaussetzungen oder Bepreisung durch die Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage nicht beobachtbarer Parameter. Zum 30. Juni 2023 wurden Positionen in Stammaktien von Ebene 1 in Ebene 3 L&G Clean Energy UCITS ETF mit einem Gesamtwert von 953.712 US\$ übertragen (30. Juni 2022: null). Übertragungen aus Ebene 3 geschehen dann, wenn diese Wertpapiere nicht länger ausgesetzt oder durch die Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage nicht beobachtbarer Parameter bepreist sind.

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 erfolgten keine Übertragungen von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten zwischen den verschiedenen Ebenen der Zeitwerthierarchie. Die Übertragungen von Ebene 1 oder Ebene 2 in die Ebene 3 sind das Ergebnis von Handelsaussetzungen oder Bepreisung durch die Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage nicht beobachtbarer Parameter. Übertragungen aus Ebene 3 geschehen dann, wenn diese Wertpapiere nicht länger ausgesetzt oder durch die Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage nicht beobachtbarer Parameter bepreist sind.

Die folgende Tabelle enthält Angaben zu den signifikanten nicht beobachtbaren Parametern, die bei der Bewertung der Gesellschaft von Anlagen und Finanzinstrumenten Anwendung fanden, die am 30. Juni 2023 und am 30. Juni 2022 der Ebene 3 der Zeitwerthierarchie zugeordnet waren.

Die Tabelle gibt ebenfalls die Anfälligkeit gegenüber Änderungen bei den signifikanten nicht beobachtbaren Parametern an und zeigt die Auswirkung eines Abschlags von 10 % auf den Wert von Anlagen und die Auswirkung auf den NIW des Fonds. Das Management hat die Anwendung eines Abschlags von 10 % zur Durchführung einer Sensitivitätsanalyse beschlossen, da dies als angemessen für einen angepassten Verkaufskurs für illiquide Wertpapiere erachtet werden kann.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Wertpapiere der Ebene 3 (Fortsetzung)

L&G Clean Energy UCITS ETF	30. Juni 2023	30. Juni 2023
Anlage	Stammaktien	Stammaktien
Zeitwert (US\$)	947.407	947.407
Hauptbewertungstechniken	Zuletzt gehandelter Preis	Zuletzt gehandelter Preis
Wert bei Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	852.666	852.666
NIW je Anteil vor Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	0,05026	0,05026
NIW je Anteil nach Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	0,04523	0,04523
Auswirkung der Anwendung des Abschlags bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern auf den NIW je Anteil	(0,044) %	(0,044) %

5. Derivatrisiko

A. Gesamtrisiko

Im Zusammenhang mit Fonds mit physischer Nachbildung wird das Gesamtrisiko mittels des Commitment-Ansatzes berechnet. Der Commitment-Ansatz ist wesentlicher Bestandteil der laufenden Überwachung und Verwaltung des Marktrisikos der Fonds. Der Commitment-Ansatz ist geeignet, weil sich diese fünfunddreißig Fonds gemäß den OGAW-Vorschriften der Zentralbank im Rahmen ihrer komplexen Anlagestrategie keiner derivativen Finanzinstrumente bedienen. Das globale Gesamtrisiko der einzelnen Fonds, d. h. das vom Fonds durch seinen Einsatz von Terminkontrakten erzeugte zusätzliche Risiko und Leverage, ist mindestens täglich zu berechnen (wenn Terminkontrakte gehalten werden) und darf zu keinem Zeitpunkt 100 % des NIW des Fonds übersteigen.

B. Value-at-Risk („VaR“)

Im laufenden und im vorangegangenen Geschäftsjahr haben die Anlageverwalter bei der Ermittlung des globalen Risikos für die übrigen Fonds den relativen Value-at-Risk-Ansatz („relativer VaR-Ansatz“) angewandt. Die Fonds bilden Indizes nach (für einen Daily Leveraged Index wird gemäß den OGAW-Vorschriften der Zentralbank der Non-leveraged Index als Referenzindex für den relativen VaR angewandt) und basieren auf einem Konfidenzniveau von 99 %. Der relative VaR wird monatlich ausgewiesen.

Die Hebelwirkung (Leverage) wird mittels der Summe der Nominalbeträge berechnet, die den Swap in die Basiswerte umrechnet. Die Leverage wird überwacht und ist im Verhältnis zum Nettoinventarwert auf 100 % ausgerichtet. Die maximale Abweichung 100 % bis zum nächsten Perzentil wurde im Geschäftsjahr eingehalten. Dies zeigt, dass der Fonds den Basisindex auf einer Eins-zu-eins-Basis abzüglich Gebühren und aufgelaufener Kosten nachbildet. Das einseitige Konfidenzniveau des Fonds liegt bei 99 %, die Haltedauer beträgt einen Tag. Der historische Betrachtungszeitraum beträgt mindestens ein Jahr. Es kann jedoch, wenn dies angemessen ist, auch ein kürzerer Betrachtungszeitraum angewandt werden.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

5. Derivaterisiko (Fortsetzung)

B. VaR (Fortsetzung)

Die Fonds wenden keinen direkten Hebel (Leverage) an; die einzige auf die 2x-Short-Fonds und die 2x-Leveraged-Fonds mit synthetischer Nachbildung anwendbare Leverage ist in den jeweiligen, von den einzelnen Fonds nachgebildeten Index integriert, und somit nicht auf Fondsebene. Die Fonds streben stets einen relativen VaR von 1 an, außer für die 2x Short- und 2x Leveraged-Fonds, die einen relativen VaR von 2 haben. Dies ist dadurch bedingt, dass der VaR des Fonds gegenüber dem VaR des nicht gehebelten Index gemessen wird statt gegenüber der VaR des direkt nachgebildeten Index mit integrierter Leverage. Der ETF VaR 1D repräsentiert die tägliche Volatilität des Fonds-NIW im Verlauf des Berichtszeitraums und entspricht der Standardabweichung des Tagesertrags, ausgehend von einer Normalverteilung mit einem Konfidenzniveau von 99 %. Für die nachstehend aufgeführten Fonds wird das Risiko anhand des relativen VaR überwacht. Die umseitige Tabelle weist den relativen VaR für die einzelnen Fonds zum 30. Juni 2023 aus, berechnet mit einem Konfidenzniveau im 99. Perzentil. Die Mindest-, Durchschnitts- und Höchstausschüttung der VaR-Limits im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 werden ebenfalls auf den folgenden Seiten angegeben.

Fonds	ETF VaR 1T	ETF VaR 5T	ETF VaR 20T	Geringste Ausnutzung	Durchschnittliche Ausnutzung	Höchste Ausnutzung	Tracking-Index	Index VaR 1T	Index VaR 5T	Index VaR 20T	Stichprobe Tage
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	2,55 %	5,71 %	11,41 %	49,96 %	49,99 %	50,06 %	Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return	2,55 %	5,70 %	11,40 %	262
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	3,10 %	6,92 %	13,84 %	50,50 %	50,59 %	51,10 %	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR	3,03 %	6,77 %	13,55 %	262
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	2,93 %	6,55 %	13,10 %	50,05 %	50,07 %	50,12 %	Barclays Backwardation Tilt Multi-Strategy Capped Total Return Index	2,92 %	6,54 %	13,07 %	262

*Für diese Fonds wurde die nicht gehebelte Version des VaR verwendet.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

5. Derivaterisiko (Fortsetzung)

B. VaR (Fortsetzung)

Für die nachstehend aufgeführten Fonds wird das Risiko anhand des relativen VaR überwacht. Die nachstehende Tabelle zeigt den relativen VaR für die einzelnen Fonds zum 30. Juni 2022, berechnet mit einem Konfidenzniveau im 99. Perzentil. Die Mindest-, Durchschnitts- und Höchstaussnutzung der VaR-Limits im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 werden ebenfalls nachstehend angegeben.

Fonds	ETF VaR 1T	ETF VaR 5T	ETF VaR 20T	Geringste Ausnutzung	Durchschnittliche Ausnutzung	Höchste Ausnutzung	Tracking-Index	Index VaR 1T	Index VaR 5T	Index VaR 20T	Stichprobe Tage
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	2,78 %	6,22 %	12,44 %	49,26 %	49,51 %	49,98 %	Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return	2,78 %	6,22 %	12,44 %	262
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	3,83 %	8,56 %	17,12 %	50,20 %	50,42 %	51,03 %	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR	3,79 %	8,48 %	16,96 %	262
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	3,29 %	7,35 %	14,71 %	50,06 %	50,11 %	50,20 %	Barclays Backwardation Tilt Multi-Strategy Capped Total Return Index	3,28 %	7,35 %	14,69 %	254

*Für diese Fonds wurde die nicht gehebelte Version des VaR verwendet.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen

Um seine vertraglichen Rechte klarer zu definieren und Rechte zu sichern, die dazu beitragen, das Kontrahentenrisiko der Fonds zu verringern, haben die Fonds mit ihren Finanzinstrumenten einen ISDA-Rahmenvertrag abgeschlossen oder eine ähnliche Vereinbarung getroffen. Zu den ähnlichen Vereinbarungen zählen standardisierte Rahmenverträge für Repo-Geschäfte (Global Master Repurchase Agreements). Zu den ähnlichen Finanzinstrumenten zählen Derivate und umgekehrte Pensionsgeschäfte.

Der ISDA-Rahmenvertrag und ähnliche Rahmenverträge zur Aufrechnung entsprechen nicht den Kriterien für eine Saldierung in der Bilanz. Das liegt daran, dass die Fonds derzeit keinen einklagbaren Rechtsanspruch auf die Saldierung der ausgewiesenen Beträge haben, weil der Anspruch auf Saldierung nur bei Eintritt künftiger Ereignisse einklagbar ist, beispielsweise ein Ausfall der Fonds oder der Kontrahenten oder andere Kreditereignisse.

Ein ISDA-Rahmenvertrag ist eine bilaterale Vereinbarung zwischen einem Fonds und einem Kontrahenten, der außerbörslich gehandelte Derivate regelt, einschließlich OTC-Swaps und Devisenterminkontrakte, und in aller Regel unter anderem Bedingungen zur Stellung von Sicherheiten sowie Aufrechnungsbestimmungen für den Fall eines Verzugs und/oder einer Kündigung vorsieht. Der ISDA-Rahmenvertrag sieht normalerweise individuelle Nettozahlungen im Fall eines Verzugs (Close-out Netting) oder ähnlicher Vorkommnisse wie dem Konkurs oder der Insolvenz des Kontrahenten vor.

Der Fonds und seine Kontrahenten haben sich jedoch für die Abrechnung aller Transaktionen auf Bruttobasis entschieden; im Falle eines Verzugs der anderen Partei hat aber jede Partei die Option, alle offenen Kontrakte auf Nettobasis abzurechnen. Zu einem Verzugsereignis gehören:

- Nichtleistung von Zahlungen bei Fälligkeit durch eine Partei;
- Nichterfüllung einer (sonstigen) vertraglichen Verpflichtung durch eine Partei, wenn nicht innerhalb von 30 Tagen Abhilfe geschaffen wird, nachdem die Partei über die Nichterfüllung unterrichtet wurde, und
- Konkurs.

Zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 unterlagen die in der Tabelle auf den Seiten 198 bis 202 im Einzelnen aufgeführten Derivate Aufrechnungsrahmenvereinbarungen mit den Derivatekontrahenten. Alle derivativen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds werden bei diesen Kontrahenten gehalten, und der verbleibende Saldo, der von den Fonds vorgehalten wird, dient dem Zweck der Bereitstellung von Sicherheiten für derivative Positionen.

Für keinen der Fonds mit physischer Nachbildung bestehen Rahmenvereinbarungen zur Aufrechnung:

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle weist die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 aus:

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Vermögenswerte	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge Bilanz	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Erhaltene Barsicherheiten*	
	Finanzielle Vermögenswerte						
	OTC-Swaps						
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Merrill Lynch International	192.143 \$	-	192.143 \$	-	-	192.143 \$

* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle weist die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 aus (Fortsetzung):

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Vermögenswerte	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge Bilanz	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Erhaltene finanzielle Sicherheiten*	
	Finanzielle Vermögenswerte						
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte						
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	426.422.859 \$	-	426.422.859 \$	-	(426.422.859) \$	-
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Merrill Lynch International	30.889.828 \$	-	30.889.828 \$	-	(30.592.384) \$	297.444 \$
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	1.544.114.955 \$	-	1.544.114.955 \$	-	(1.544.114.955) \$	-

* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle weist die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 aus (Fortsetzung):

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Verbindlichkeiten	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge Bilanz	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Verbindlichkeiten	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Verpfändete Barsicherheiten*	
	Finanzielle Verbindlichkeiten						
	OTC-Swaps						
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	9.243.839 \$	-	9.243.839 \$	-	(9.243.839) \$	-
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	53.399.628 \$	-	53.399.628 \$	-	(53.399.628) \$	-

* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle weist die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 aus:

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Vermögenswerte	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge Bilanz	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Erhaltene finanzielle Sicherheiten*	
	Finanzielle Vermögenswerte						
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte						
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	623.438.724 \$	-	623.438.724 \$	-	(623.438.724) \$	-
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	29.294.923 \$	-	29.294.923 \$	-	(29.294.923) \$	-
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	795.902.955 \$	-	795.902.955 \$	-	(795.902.955) \$	-

* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle weist die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 aus (Fortsetzung):

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Verbindlichkeiten	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge Bilanz	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Verbindlichkeiten	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Verpfändete Barsicherheiten*	
	Finanzielle Verbindlichkeiten						
	OTC-Swaps						
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	44.009.038 \$	-	44.009.038 \$	-	(28.330.000) \$	(15.679.038) \$
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	869.132 \$	-	869.132 \$	-	(90.620) \$	(778.512) \$
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	57.878.638 \$	-	57.878.638 \$	-	(21.010.000) \$	(36.868.638) \$

* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

14. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile

Jeder Fonds wurde als Berichtsfonds nach den britischen Offshore-Fonds-Regelungen zugelassen (oder, sofern nicht anders angegeben, innerhalb einer angemessenen Frist nach seiner Genehmigung durch die Zentralbank). Als berichtende Fonds wird die Gesellschaft für gewöhnlich keine Dividenden beschließen, kann dies aber nach Ermessen des Verwaltungsrats zu einem bestimmten Datum tun. Der Verwaltungsrat kann von Zeit zu Zeit Anteilsklassen mit unterschiedlichen Ausschüttungsrichtlinien auflegen. Dividenden, sofern gezahlt, werden (falls in einem entsprechenden fondsspezifischen Prospektnachtrag nicht anders angegeben) in der Basiswährung des jeweiligen Fonds deklariert.

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 zahlten die folgenden Fonds die folgenden Ausschüttungen:

Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023		Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	
	Ex-Tag	Dividendensatz	Ex-Tag	Dividendensatz
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF				
USD Distributing ETF	15. September 2022	0,0897 \$	09.09.2021	0,0787 \$
	15. Dezember 2022	0,0904 \$	09.12.2021	0,0819 \$
	9. März 2023	0,0870 \$	10.03.2022	0,0767 \$
	15. Juni 2023	0,1157 \$	09.06.2022	0,0870 \$
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF				
GBP Distributing ETF	14. Juli 2022	0,0549 £	15.07.2021	0,0321 £
	19. Januar 2023	0,1080 £	13.01.2022	0,0425 £
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF				
GBP Distributing ETF	14. Juli 2022	0,0906 £	15.07.2021	0,0849 £
	19. Januar 2023	0,1283 £	13.01.2022	0,0808 £
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF				
USD Distributing ETF	14. Juli 2022	0,1438 \$	15.07.2021	0,1238 \$
	19. Januar 2023	0,1898 \$	13.01.2022	0,1191 \$
L&G China CNY Bond UCITS ETF¹				
EUR Hedged Distributing ETF	14. Juli 2022	0,1397 €	n. zutr.	n. zutr.
USD Distributing ETF	14. Juli 2022	0,1282 \$	15.07.2021	0,1534 \$
EUR Hedged Distributing ETF	19. Januar 2023	0,1357 €	13.01.2022	0,1314 €
USD Distributing ETF	19. Januar 2023	0,1206 \$	13.01.2022	0,1442 \$
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF				
GBP Distributing ETF	14. Juli 2022	0,0042 £	n. zutr.	n. zutr.
	19. Januar 2023	0,0464 £	n. zutr.	n. zutr.
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF				
USD Distributing ETF	14. Juli 2022	0,1021 \$	15.07.2021	0,0769 \$
	19. Januar 2023	0,1283 \$	13.01.2022	0,0947 \$

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

14. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile (Fortsetzung)

Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023		Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	
	Ex-Tag	Dividendensatz	Ex-Tag	Dividendensatz
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF				
CHF Hedged Distributing ETF	14. Juli 2022	0,1123 CHF	n. zutr.	n. zutr.
GBP Hedged Distributing ETF	14. Juli 2022	0,1845 £	13.01.2022	0,0176 £
USD Distributing ETF	14. Juli 2022	0,1691 \$	15.07.2021	0,1168 \$
CHF Hedged Distributing ETF	19. Januar 2023	0,2059 CHF	n. zutr.	n. zutr.
GBP Hedged Distributing ETF	19. Januar 2023	0,1972 £	n. zutr.	n. zutr.
USD Distributing ETF	19. Januar 2023	0,1932 \$	13.01.2022	0,1529 \$
L&G ESG Green Bond UCITS ETF²				
EUR Distributing ETF	14. Juli 2022	0,0366 €	15.07.2021	0,011 €
	19. Januar 2023	0,0516 €	13.01.2022	0,0197 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF				
EUR Distributing ETF	15. September 2022	0,0515 €	09.09.2021	0,0626 €
	15. Dezember 2022	0,0427 €	09.12.2021	0,0990 €
	9. März 2023	0,0227 €	10.03.2022	0,0150 €
	9. März 2023	0,3218 €	09.06.2022	0,3014 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF				
USD Distributing ETF	15. September 2022	0,1071 \$	09.09.2021	0,0945 \$
	15. Dezember 2022	0,0662 \$	09.12.2021	0,0662 \$
	9. März 2023	0,1489 \$	10.03.2022	0,1314 \$
	9. März 2023	0,0971 \$	09.06.2022	0,1129 \$

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

14. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile (Fortsetzung)

Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023		Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	
	Ex-Tag	Dividendensatz	Ex-Tag	Dividendensatz
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF				
USD Distributing ETF	15. September 2022	0,2379 \$	09.09.2021	0,1073 \$
	15. Dezember 2022	0,0440 \$	09.12.2021	0,0434 \$
	9. März 2023	0,0072 \$	10.03.2022	0,0324 \$
	15. Juni 2023	0,0980 \$	09.06.2022	0,1019 \$
L&G India INR Government Bond UCITS ETF				
USD Distributing ETF	14. Juli 2022	0,2764 \$	13.01.2022	0,0946 \$
	19. Januar 2023	0,2735 \$	n. zutr.	n. zutr.

¹Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

²Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

15. Getrennte Haftung

Die Gesellschaft ist als Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen ihren Fonds strukturiert. Aufgrund irischen Rechts stehen die Vermögenswerte eines Fonds nicht zur Begleichung der Verbindlichkeiten eines anderen Fonds zur Verfügung (diese Bestimmung gilt auch im Falle der Insolvenz und ist allgemein verbindlich für Gläubiger). Ferner enthält gemäß irischem Recht jeder Vertrag, den die Gesellschaft für einen Fonds (oder mehrere Fonds) abschließt, eine Bestimmung, dass der Vertragspartner keinen Rückgriff auf die Vermögenswerte von Fonds außer dem bzw. den Fonds, für den bzw. die der Vertrag geschlossen wird, hat. Die indexbasierten OTC-Swaps, die die Fonds von Zeit zu Zeit eingehen, enthalten ebenfalls ausdrückliche Bestimmungen zum Grundsatz der getrennten Haftung nach irischem Recht.

Da die Gesellschaft jedoch ein einziges Rechtssubjekt ist, das in anderen Hoheitsgebieten tätig sein oder Vermögenswerte in seinem Namen halten oder Forderungen unterliegen kann, die diese Trennung nicht unbedingt anerkennen, bleibt, falls an einem Gerichtsstand außerhalb Irlands eine Schuld oder Verbindlichkeit eines Fonds gerichtlich gegen die Gesellschaft geltend gemacht wird, ein Risiko, dass in einem Hoheitsgebiet, in dem dieser Anspruch geltend gemacht wird, der Grundsatz der getrennten Haftung zwischen den Fonds nicht anerkannt wird und ein Gläubiger versuchen wird, Vermögenswerte eines Fonds zur Befriedigung einer Schuld oder Verbindlichkeit eines anderen Fonds beschlagnahmen oder pfänden zu lassen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

16. Nettoinventarwert

Die folgenden Tabellen fassen den NIW, die in Umlauf befindlichen Anteile und den NIW je Anteil am Ende der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023, 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 zusammen.

Fonds/Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2023 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2023 Je Anteil
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	451.524.766	21.004.633	21,4964
L&G Gold Mining UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	130.150.606	4.376.093	29,7412
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	34.114.240	6.643.255	5,1351
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	1.044.049.186	44.755.616	23,3277
L&G Cyber Security UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	2.523.150.526	122.005.361	20,6806
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	1.043.928.805	52.877.000	19,7425
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	46.560.348	4.306.462	10,8117
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	254.539.630	16.658.900	15,2794
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	444.679.042	28.625.000	15,5346

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

16. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

Fonds / Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2023 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2023 Je Anteil
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	410.941.069	26.043.500	15,7790
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	123.316.047	9.925.000	12,4247
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF – EUR Accumulating ETF ¹	EUR	394.750.568	28.658.647	13,7742
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	US\$	1.355.141.536	88.170.262	15,3695
L&G Clean Energy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	213.422.628	18.851.687	11,3211
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	95.039.635	10.482.900	9,0661
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	106.721.952	13.937.200	7,6573
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	211.249.662	24.370.812	8,6681
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF	EUR	53.782.745	5.454.358	9,8605
L&G China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	136.959.617	14.507.764	9,4404
L&G China CNY Bond UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF ²	EUR	1.072.680	108.332	9,9017
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	122.247.044	14.451.560	8,4590
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	174.252.468	20.594.303	8,4611
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	71.817.093	7.928.277	9,0583
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – EUR Hedged Accumulating ETF	EUR	163.608.395	19.178.769	8,5307
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Accumulating ETF	CHF	230.538.739	27.354.567	8,4277
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – GBP Hedged Distributing ETF	GBP	6.441.413	759.983	8,4757
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Distributing ETF	CHF	13.871.753	1.535.659	9,0330
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	534.389.498	103.920.000	5,1423
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF - EUR Distributing ETF	EUR	29.214.282	2.857.580	10,2234
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	21.343.014	2.580.000	8,2724
L&G Digital Payments UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	23.255.348	3.485.000	6,6729
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF – USD Accumulating ETF	US\$	1.679.221.354	127.965.082	13,1224
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF - GBP Accumulating ETF ³	GBP	96.881	10.000	9,6881
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF – USD Distributing ETF	US\$	17.809.948	2.011.350	8,8547
L&G India INR Government Bond UCITS ETF – USD Distributing ETF	US\$	387.008.056	42.680.000	9,0676
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁴	US\$	3.701.493	350.000	10,5756
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁵	US\$	3.800.991	344.000	11,0493
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁵	US\$	2.619.847	205.000	12,7797
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁵	US\$	7.810.579	720.000	10,8480
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁶	US\$	3.881.330	341.000	11,3821
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁶	US\$	4.178.315	342.724	12,1914
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF ⁷	US\$	11.012.963	1.089.006	10,1128
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF - USD Distributing ETF ⁷	US\$	4.156.386	411.000	10,1128

²Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

³Diese Anteilklasse wurde am 21. Juni 2023 aufgelegt.

⁴Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

⁵Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

⁶Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

⁷Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Diese Anteilklassen wurden am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

16. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2022 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2022 Je Anteil
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	658.160.227	28.768.433	22,8779
L&G Gold Mining UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	127.216.429	4.947.093	25,7154
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	30.849.810	6.856.699	4,4992
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	801.871.883	44.725.616	17,9287
L&G Cyber Security UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	2.471.074.322	132.256.776	18,6839
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	774.230.772	53.500.000	14,4716
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	33.957.492	3.100.000	10,9540
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	264.575.344	20.282.900	13,0443
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	309.086.103	23.950.000	12,9055

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

16. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2022 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2022 Je Anteil
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	223.476.589	19.233.500	11,6191
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	125.221.037	10.500.000	11,9258
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF – EUR Accumulating ETF ¹	EUR	92.121.663	7.843.647	11,7447
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	US\$	859.813.276	67.635.262	12,7125
L&G Clean Energy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	182.297.398	17.600.000	10,3578
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	68.896.293	7.315.000	9,4185
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	84.670.827	10.060.000	8,4166
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	72.941.335	8.470.400	8,6113
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF	EUR	6.406.121	660.000	9,7062
L&G China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	178.181.981	17.550.609	10,1525
L&G China CNY Bond UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF ²	EUR	76.850.171	6.896.085	11,1440
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	91.455.100	10.700.000	8,5472
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	290.854.357	34.215.208	8,5007
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	64.739.582	7.424.949	8,7192
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - EUR Hedged Accumulating ETF ³	EUR	174.403.942	20.588.941	8,4708
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Accumulating ETF	CHF	378.580.948	44.715.497	8,4664
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – GBP Hedged Distributing ETF	GBP	4.449.806	513.137	8,6718
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF – CHF Hedged Distributing ETF	CHF	13.791.037	1.468.566	9,3908
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	496.926.950	92.000.000	5,4014
L&G ESG Green Bond UCITS ETF - EUR Distributing ETF ³	EUR	8.143.600	960.239	8,4808
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF - EUR Distributing ETF	EUR	21.293.905	2.334.080	9,1230
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	21.069.736	2.500.000	8,4279
L&G Digital Payments UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	11.594.359	2.050.000	5,6558
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF – USD Accumulating ETF	US\$	838.762.584	60.021.282	13,9744
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF – USD Distributing ETF	US\$	15.856.377	1.900.000	8,3455
L&G India INR Government Bond UCITS ETF – USD Distributing ETF	US\$	279.367.171	30.300.000	9,2200

²Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

³Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

16. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2021 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2021 Je Anteil
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	1.224.757.080	68.302.602	17,9313
L&G Gold Mining UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	155.489.496	4.632.093	33,5678
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	40.301.424	8.345.239	4,8292
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	1.254.865.415	48.425.616	25,9132
L&G Cyber Security UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	2.792.146.370	109.881.776	25,4104
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	11.383.947	819.278	13,895
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	834.154.119	45.450.000	18,3532
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	34.331.501	2.600.000	13,2044
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	612.336.023	34.232.900	17,8873
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	232.180.626	14.650.000	15,8485
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	255.630.405	13.583.500	18,8191
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	219.356.536	11.150.000	19,6732
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF – EUR Accumulating ETF1	EUR	233.988.889	17.965.798	13,0241
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF - USD Accumulating ETF ¹	US\$	1.706.212.924	114.500.000	14,9014
L&G Clean Energy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	115.243.362	8.600.000	13,4003
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	60.138.292	6.000.000	10,023
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	67.397.397	6.800.000	9,9113
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	49.902.110	4.900.000	10,1841
L&G China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF ²	US\$	427.341.761	41.100.000	10,3976
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	92.756.580	9.300.000	9,9738
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	579.585.871	57.376.000	10,1015
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	504.121	50.000	10,0824
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	459.726.448	51.900.000	8,8579
L&G ESG Green Bond UCITS ETF - EUR Distributing ETF ³	EUR	23.180.583	2.350.000	9,864

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

16. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2021 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2021 Je Anteil
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF - EUR Distributing ETF	EUR	16.295.294	1.634.080	9,9721
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	19.787.175	1.900.000	10,4143
L&G Digital Payments UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	6.274.836	600.000	10,4580

²Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

³Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

17. Segmentberichterstattung

Ein Geschäftssegment ist eine Komponente der Gesellschaft, die Geschäfte tätigt, aus denen sie Erträge erzielen kann und aus denen ihr Aufwendungen entstehen können, u. a. Erträge und Aufwendungen, die sich auf Transaktionen mit anderen Komponenten der Gesellschaft beziehen, deren operative Ergebnisse regelmäßig überprüft werden, um Entscheidungen über diesem Segment zuzuordnende Ressourcen zu treffen und seine Leistung zu beurteilen, und für das getrennte Finanzinformationen zur Verfügung stehen.

Zu den ausgewiesenen Segmentergebnissen gehören Posten, die direkt einem Segment zuzuordnen sind.

Jeder Fonds gilt als Geschäftssegment, das seinem Anlageziel entsprechend Anlagen tätigt. Die dem Verwaltungsrat der Gesellschaft gelieferten Segmentinformationen sind dieselben wie die in der Gesamtergebnisrechnung und in der Bilanz der einzelnen Fonds angegebenen. Als Hauptentscheidungsträger, der für die Zuteilung von Ressourcen und die Beurteilung der Performance der Geschäftssegmente zuständig ist, ist der Verwaltungsrat bestimmt worden.

Geografische Angaben

Die Entscheidungen des Anlageverwalters in Bezug auf die Portfoliostrukturierung basieren auf einer einzigen, integrierten Anlagestrategie, um die Wertentwicklung des jeweiligen Index der einzelnen Fonds zu erzielen, und die Wertentwicklung der einzelnen Fonds wird unter Bezugnahme auf den jeweiligen Index bewertet. Der dem einzelnen Fonds zuzuordnende Ertrag leitet sich aus geografischen Standorten (d. h. das Gründungsland des Emittenten der Instrumente) entsprechend den in der Aufstellung der Vermögenswerte für die Fonds mit physischer Nachbildung angegebenen ab. Die täglichen Entscheidungen in Bezug auf die Portfoliostrukturierung werden von den Anlageverwaltern der einzelnen Fonds getroffen. Bei den Fonds mit synthetischer Nachbildung werden die Erlöse, die den umgekehrten Pensionsgeschäften und den Geldmarktinstrumenten zuzurechnen sind, vom Gründungsland des Emittenten der Instrumente abgeleitet; bei den Swap-Kontrakten erfolgt keine spezifische Länderallokation.

Die Gesellschaft ist in Irland ansässig. Sämtliche Erträge der Gesellschaft aus Anlagen stammen in erster Linie von Unternehmen, die in anderen Ländern als Irland gegründet wurden. Die Aufschlüsselung der wichtigsten Komponenten der Erträge aus anderen Ländern ist nachstehend angegeben.

	Vereinigtes Königreich	Rest Europas	Vereinigte Staaten	Japan	Rest der Welt	Gesellschaft insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023						
Nettoertrag nach Segmenten*	110.549.921	317.515.074	666.180.828	139.064.244	131.349.802	1.364.659.869

	Vereinigtes Königreich	Rest Europas	Vereinigte Staaten	Japan	Rest der Welt	Gesellschaft insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022						
Nettoertrag nach Segmenten*	(192.843.109)	(1.562.394.319)	75.891.276	(237.780.540)	(419.003.968)	(2.336.130.660)

* Stellt die Erträge insgesamt abzüglich Zinsaufwendungen dar

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

17. Segmentberichterstattung (Fortsetzung)

Wichtige Kunden

Die Gesellschaft betrachtet die Inhaber von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen ihrer Fonds nicht als Kunden, da sie außer mit autorisierten Teilnehmern nicht direkt mit Anlegern handelt (d. h. die Gesellschaft erlaubt keine Zeichnungen und Rücknahmen von anderen Anlegern als autorisierten Teilnehmern). Die Gesellschaft behandelt jedoch die Inhaber von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen ihrer Fonds strikt im Sinne der Offenlegungsanforderungen bezüglich „wichtiger Kunden“ nach IFRS 8.34 als Kunden, weil sie auf die von den Vermögenswerten der einzelnen Fonds abgezogene TER zur Finanzierung des Betriebs des jeweiligen Fonds angewiesen ist.

Die Gesellschaft ist innerhalb des Abwicklungsmodells International Central Securities Depository (ICSD) tätig. Im Rahmen des ICSD-Abwicklungsmodell werden alle Anteilsbestände an der Gesellschaft im Anteilinhaberregister der Gesellschaft im Namen eines einzigen rechtlichen Anteilinhabers – The Bank of New York Depository (Nominees) Limited als das zum Nominee der gemeinsamen Verwahrstelle bestellte Unternehmen – eingetragen. Deshalb ist The Bank of New York Depository (Nominees) Limited ein wichtiger Kunde, der das rechtliche Eigentum an 100 % des ausgegebenen Anteilkapitals der Gesellschaft hält, nicht aber das wirtschaftliche Eigentum.

Zur Identifizierung der wirtschaftlichen Eigentümer der Anteile an der Gesellschaft erhält die Gesellschaft Teilnehmerberichte von der ICSD, in denen das wirtschaftliche Eigentum an Anteilen an der Gesellschaft, die über das ICSD-Abwicklungsmodell gehalten werden, nachgewiesen wird (der „Teilnehmerbericht“). Allerdings erscheinen Endanleger, die Anteile an Börsen kaufen (d. h. die eigentlichen wirtschaftlichen Eigentümer), nicht im Teilnehmerbericht. Dies liegt daran, dass sie ihre Anteile in der Regel über einen Intermediär (Makler/Nominee oder eine lokale gemeinsame Verwahrstelle) halten, der an ihrer Stelle im Teilnehmerbericht verzeichnet ist.

Kaufen und verkaufen Endanleger ihre Anteile an Börsen, die lokale Clearing- und Abrechnungssysteme verwenden (z. B. Borsa Italiana), werden diese Endanleger in einem weiteren Schritt aus dem Teilnehmerbericht entfernt. Dies liegt daran, dass das jeweilige von einer bestimmten Börse genutzte Clearing- und Abrechnungssystem (zum Beispiel Monte Titoli für über die Borsa Italiana abgewickelte Transaktionen) in der Regel im Teilnehmerbericht für alle an der jeweiligen Börse getätigten Anlagen erscheint. Das ausländische Abrechnungssystem führt wiederum seine eigenen Aufzeichnungen zu den lokalen Intermediären (Makler/Nominees), die im Namen der Endanleger Anteile halten.

Es ist daher der Gesellschaft nicht möglich, alle Endanleger (d. h. wirtschaftlichen Eigentümer), die an Anteilen der Gesellschaft beteiligt sind, zu identifizieren. Ebenso ist es der Gesellschaft nicht möglich, genau zu quantifizieren, wie viele Endanleger es für eine bestimmte Anteilklasse der Gesellschaft gibt. Dementsprechend ist es der Gesellschaft nur möglich, den einzigen rechtlichen Anteilinhaber der Gesellschaft – The Bank of New York Depository (Nominees) Limited – zu identifizieren.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

18. Transaktionskosten

Transaktionskosten werden direkt bei ihrer Entstehung in der Gesamtergebnisrechnung erfasst und im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Transaktionskosten in Zusammenhang mit dem Kauf und Verkauf von Schuldtiteln, Swaps und Geldmarktfonds sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Sie lassen sich nicht ohne Weiteres und auf verlässliche Art ermitteln, da sie in den Kosten der Anlage eingebettet sind, und können nicht gesondert überprüft oder offengelegt werden.

Die nachstehende Tabelle fasst die Transaktionskosten für die Fonds mit Anlagen in Stammaktien für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 detailliert zusammen.

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
L&G Gold Mining UCITS ETF	33.410 \$	61.654 \$
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	267.883 \$	388.983 \$
L&G Cyber Security UCITS ETF	828.993 \$	2.347.962 \$
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	406.860 \$	602.949 \$
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	48.370 \$	23.447 \$
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	146.872 \$	411.379 \$
L&G Clean Water UCITS ETF	180.990 \$	206.394 \$
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	90.214 \$	114.266 \$
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	26.016 \$	59.605 \$
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹	579.583 €	64.680 €
L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ¹	49.132 \$	82.974 \$
L&G Clean Energy UCITS ETF	199.360 \$	154.979 \$
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	176.146 \$	244.572 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	21.829 \$	14.073 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	15.934 \$	16.111 \$
L&G Digital Payments UCITS ETF	11.340 \$	11.223 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	19.220 \$	46.909 \$
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF ²	1.781 \$	n. zutr.
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF ³	3.279 \$	n. zutr.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

18. Transaktionskosten (Fortsetzung)

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF ³	959 \$	n. zutr.
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF ³	2.831 \$	n. zutr.
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ⁴	6.430 \$	n. zutr.
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ⁴	597 \$	n. zutr.
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF ⁵	9.608 \$	n. zutr.

¹ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

³ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

⁴ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

⁵ Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

19. Eventualverbindlichkeiten und Verpflichtungen

Zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 gab es keine Eventualverbindlichkeiten oder -verpflichtungen.

20. Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres

Marktbedingungen

Im März 2023 stieg die Volatilität auf den globalen Märkten nach dem Stress bei US-Regionalbanken und der Übernahme der Credit Suisse durch die UBS. Die Fonds des ETF haben kein wesentliches Engagement in US-Regionalbanken oder Engagements in AT1- oder nachrangigen Schuldtiteln der Credit Suisse. Dennoch überwacht der Verwaltungsrat weiterhin laufend die Auswirkung der Marktvolatilität und deren Auswirkung auf die Fonds des ETF.

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Die für die in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte und für die in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukte erstellten regelmäßigen Angaben sind im ungeprüften Anhang enthalten.

Für die Erstellung dieser regelmäßigen Angaben werden Daten von Drittanbietern verwendet. Wo zutreffend formen diese Daten Dritter die Grundlage für die im ungeprüften Anhang verwendeten Berechnungen. Die Daten Dritter werden unter Lizenz und mit der gesetzlichen Erlaubnis der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um die Richtigkeit der zur Verfügung gestellten Daten sicherzustellen, ist es wichtig zu beachten, dass die Drittdatenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen. Sie können nicht für Schäden haftbar gemacht werden, die sich aus der Nutzung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen, das Sie in die Berechnungen setzen, entstehen. Die Verfügbarkeit von Daten ist nach wie vor eine Herausforderung, und die aufsichtsrechtlichen Vorgaben in Bezug auf den Inhalt der Offenlegungen werden sich unter Umständen weiterentwickeln. Daher sollten die im ungeprüften Anhang enthaltenen Angaben unter Berücksichtigung dieser Faktoren gelesen und verstanden werden.

Bei den in diesem Bericht enthaltenen Finanzprodukten, die die Kriterien für Fonds gemäß Artikel 8 oder 9 der SFDR nicht erfüllen, berücksichtigen die diesen Finanzprodukten zugrunde liegenden Investitionen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

20. Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Informationen zum Fonds

Am 8. Juli 2022 wurde der L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS von der Zentralbank zugelassen. Der L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ist im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg, Spanien und der Schweiz registriert.

Am 21. Juli 2022 wurden der L&G Hydrogen Economy UCITS ETF, der L&G Clean Energy UCITS ETF, der L&G Battery Value-Chain UCITS ETF, der L&G Cyber Security UCITS ETF und der L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF ebenfalls an der Mexico Stock Exchange gelistet.

Am 22. Juli 2022 wurde die abgesicherte thesaurierende EUR-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF in der Schweiz registriert und an der Swiss SIX Exchange gelistet.

Am 29. Juli 2022 wurden die folgenden Fonds von der Zentralbank zugelassen:

- L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF

Die vorstehenden Fonds sind im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und der Schweiz registriert.

Am 7. September 2022 wurden die folgenden Fonds an der LSE sowie an der Swiss SIX Exchange, der Deutschen Börse und der Borsa Italiana gelistet:

- L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF
- L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF

Am 8. September 2022 wurden die folgenden neuen Fonds der Gesellschaft von der Zentralbank zugelassen:

- L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF
- L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF

Die vorstehenden Fonds sind im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und der Schweiz registriert.

Am 26. Oktober 2022 wurden die folgenden Fonds an der LSE sowie an der Swiss SIX Exchange, der Deutschen Börse und der Borsa Italiana gelistet:

- L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF
- L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

20. Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Informationen zum Fonds (Fortsetzung)

Am 28. November 2022 wurden der L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF und der L&G Gold Mining UCITS ETF von Artikel 8- in Artikel 6-SFDR-Produkte umkategorisiert. Darüber hinaus wurde der Name des L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF geändert.

Vorvertragliche Anhänge in Übereinstimmung mit den Ebene-2-Anforderungen der SFDR in Bezug auf Fonds, die zuvor als Artikel 8 oder Artikel 9 für die Zwecke der SFDR kategorisiert waren, wurden am 28. November 2022 bei der Zentralbank eingereicht.

Der aktualisierte Nachtrag zum L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF zwecks Hinzufügung abgesicherter Anteilklassen sowie zur Aktualisierung des Tracking Error des Fonds auf 20 Bp wurde von der Zentralbank am 12. Mai 2023 genehmigt.

Am 10. Mai 2023 wurde die Börsennotierung des L&G ESG Green Bond UCITS ETF an allen Börsen, an denen der Fonds gelistet war, widerrufen (London Stock Exchange, Borsa Italiana, SIX Swiss Exchange und Deutsche Börse). Alle im L&G ESG Green Bond UCITS ETF verbliebenen Anteile wurden am 19. Mai 2023 zwangsweise zurückgenommen und alle Investitionen liquidiert.

Der L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF wurde am 2. Juni 2023 von der Zentralbank zugelassen. Der Fonds ist im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und Spanien registriert.

Am 21. Juni 2023 wurden die ausschüttenden und die thesaurierenden Anteilklassen des L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF an der Deutschen Börse gelistet.

Am 21. Juni 2023 wurde der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF ebenfalls an der Deutschen Börse gelistet.

Am 22. Juni 2023 wurde die abgesicherte thesaurierende GBP-Anteilklasse des L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF an der LSE gelistet. Die Anteilklasse ist im Vereinigten Königreich registriert.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse im Geschäftsjahr, die eine Auswirkung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 haben.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

21. Abstimmung des Nettovermögens zu Handelskursen auf das Nettovermögen gemäß Abschluss

Fonds	Zum 30. Juni 2023 USD
L&G Clean Energy UCITS ETF	
Abstimmung des Nettovermögens	
Nettovermögen nach veröffentlichten Handelspreisen	218.552.064
Anpassung für neu bewertete Stammaktie ¹	(5.129.436)
Nettovermögen gemäß Abschluss	213.422.628
Handels-NIW je USD-Anteilsklasse	11,5932

¹ Energia Innovacion y Desarrollo Fotovoltaico SA wurde zum Jahresende ausgesetzt und anschließend – auf der Grundlage beobachtbarer Parameter, die bei Wiederaufnahme des Handels auf einem aktiven Markt verfügbar sind – neu bewertet.

22. Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres

Seit dem Ende des Geschäftsjahres am 30. Juni 2023 zahlten die folgenden Fonds die nachstehenden Ausschüttungen:

Fonds	Ex-Tag	Dividendensatz
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF		
USD Distributing ETF	14. September 2023	0,0973 \$
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF		
GBP Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1385 £
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF		
GBP Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1688 £
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF		
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,2197 \$
L&G China CNY Bond UCITS ETF¹		
EUR Hedged Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1200 €
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1158 \$
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF		
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1549 \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF		
CHF Hedged Distributing ETF	20. Juli 2023	0,2155 CHF
GBP Hedged Distributing ETF	20. Juli 2023	0,1953 £
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,2077 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF		
EUR Distributing ETF	14. September 2023	0,1104 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF		
USD Distributing ETF	14. September 2023	0,0979 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF		
USD Distributing ETF	14. September 2023	0,1942 \$
L&G India INR Government Bond UCITS ETF		
USD Distributing ETF	20. Juli 2023	0,2846 \$
L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF²		
USD Distributing ETF	14. September 2023	0,0393 \$

¹ Mit Wirkung vom 28. November 2022 änderte der Fonds seinen Namen von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF.

² Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

22. Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Geopolitische Ereignisse

Der Verwaltungsrat überwacht weiterhin laufend die Entwicklungen in Osteuropa sowie alle potenziellen direkten oder indirekten wirtschaftlichen Auswirkungen auf den ETF.

Am 15. August 2023 wurden die ausschüttenden und thesaurierenden Anteilklassen des L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF, des L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF, des L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF, des L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF, des L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF und des L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF an der SIX Swiss Exchange gelistet und in der Schweiz registriert.

Am 17. August 2023 wurden der L&G Artificial Intelligence UCITS ETF, der L&G Clean Water UCITS ETF, der L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF, L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating Share Class, der L&G India INR Government Bond UCITS ETF und der L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF ebenfalls an der Mexico Stock Exchange gelistet.

Die in EUR abgesicherte thesaurierende Anteilklasse des L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF ist zum Vertrieb in Deutschland, Österreich, Italien und Luxemburg zugelassen. Die Anteilklasse wurde in der Schweiz registriert und am 22. August 2023 an der SIX Swiss Exchange gelistet.

Die in CHF abgesicherte thesaurierende Anteilklasse des L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF ist für den Vertrieb in Deutschland und Österreich registriert. Die Anteilklasse wurde in der Schweiz registriert und am 22. August 2023 an der SIX Swiss Exchange gelistet.

Am 29. August wurden die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Fonds in Singapur gemäß dem „Restricted Scheme“ registriert.

Fonds

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

L&G Clean Energy UCITS ETF

L&G Clean Water UCITS ETF

L&G Cyber Security UCITS ETF

L&G Digital Payments UCITS ETF

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

L&G China CNY Bond UCITS ETF

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

L&G Gold Mining UCITS ETF

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

L&G India INR Government Bond UCITS ETF

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF

L&G ROBO Global Robotics and Automation UCITS ETF

Am 30. August 2023 wurde der L&G Global Brands UCITS ETF von der Zentralbank zugelassen. Der L&G Global Brands UCITS ETF ist im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und Spanien registriert.

Der L&G Global Brands UCITS ETF wurde am 21. September 2023 aufgelegt.

Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

22. Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Der L&G Global Brands UCITS ETF wurde am 27. September 2023 sowohl an der LSE als auch an der Borsa Italiana und an der Deutschen Börse gelistet.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres, die eine Auswirkung auf den Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 haben.

23. Genehmigung des Jahresabschlusses

Der Verwaltungsrat hat den geprüften Abschluss am 25. Oktober 2023 genehmigt.

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2022: 94,72 %)					
1.017.000	Barclays Bank Plc	5,40 %	24.07.2023	1.017.000	0,23
1.649.000	Barclays Bank Plc	5,40 %	24.07.2023	1.649.000	0,36
423.756.859	Barclays Bank Plc	5,40 %	24.07.2023	423.756.859	93,85
Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt				426.422.859	94,44
Nominal	Beschreibung			Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens
Swap-Kontrakte (30. Juni 2022: (6,69) %)					
460.799.482	Dow Jones-UBS Commodity Index Total Return ¹	21.07.2023		(9.243.839)	(2,05)
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten				(9.243.839)	(2,05)
Nominal	Beschreibung			Wert US\$	% des Nettover- mögens
Geldmarktinstrumente (30. Juni 2022: 7,53 %)					
20.064.103	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund			20.064.103	4,44
Geldmarktinstrumente insgesamt				20.064.103	4,44
Gesamtanlagen					
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				426.422.859	94,44
Geldmarktinstrumente				20.064.103	4,44
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten				(9.243.839)	(2,05)
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				14.281.643	3,17
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen				451.524.766	100,00

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	4,35
Einlagen bei Kreditinstituten	92,44
Sonstige Vermögenswerte	3,21
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

L&G Gold Mining UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,64 %)			
Australien (30. Juni 2022: 17,30 %)			
261.796	Capricorn Metals Ltd	702.300	0,54
1.452.442	Evolution Mining Ltd	3.113.215	2,39
724.979	Gold Road Resources Ltd	716.649	0,55
595.972	Newcrest Mining Ltd	10.481.252	8,05
984.827	Northern Star Resources Ltd	7.919.201	6,09
1.597.422	Ramelius Resources Ltd	1.339.815	1,03
1.526.451	Regis Resources Ltd	1.859.467	1,43
2.091.529	Silver Lake Resources Ltd	1.343.525	1,03
1.471.744	Westgold Resources Ltd	1.410.747	1,08
Australien insgesamt		28.886.171	22,19
Kanada (30. Juni 2022: 46,68 %)			
325.001	Agnico Eagle Mines Ltd (Units)	16.247.114	12,48
204.398	Alamos Gold Inc - Class A	2.437.504	1,87
220.008	Centerra Gold Inc	1.320.142	1,01
214.113	Dundee Precious Metals Inc (Units)	1.415.835	1,09
596.048	Equinox Gold Corp	2.734.208	2,10
229.904	First Majestic Silver Corp	1.301.338	1,00
440.662	Fortuna Silver Mines Inc	1.435.306	1,10
932.759	IAMGOLD Corp	2.474.220	1,90
159.190	K92 Mining Inc	691.744	0,53
198.800	Karora Resources Inc	608.461	0,47
2.429.466	Kinross Gold Corp	11.603.516	8,92
216.875	Lundin Gold Inc	2.597.769	2,00
1.067.390	New Gold Inc	1.161.575	0,89
165.000	Orla Mining Ltd	693.299	0,53
193.204	Pan American Silver Corp	2.816.914	2,17
111.900	SilverCrest Metals Inc	656.226	0,50
188.301	Torex Gold Resources Inc	2.678.144	2,06

L&G Gold Mining UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,64 %) (Fortsetzung)			
Kanada (30. Juni 2022: 46,68 %) (Fortsetzung)			
119.800	Victoria Gold Corp	698.933	0,54
116.059	Wesdome Gold Mines Ltd	605.187	0,47
Kanada insgesamt		54.177.435	41,63
Südafrika (30. Juni 2022: 15,74 %)			
543.323	AngloGold Ashanti Ltd	11.440.373	8,79
864.534	Gold Fields Ltd	11.973.617	9,20
Südafrika insgesamt		23.413.990	17,99
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 3,03 %)			
1.207.064	Hochschild Mining Plc	1.091.101	0,84
Vereinigtes Königreich insgesamt		1.091.101	0,84
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 16,89 %)			
597.629	Coeur Mining Inc	1.697.267	1,31
484.235	Newmont Corp	20.657.465	15,87
Vereinigte Staaten insgesamt		22.354.732	17,18
Stammaktien insgesamt		129.923.429	99,83
Gesamtanlagen			
Stammaktien		129.923.429	99,83
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		227.177	0,17
		130.150.606	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,77
Sonstige Vermögenswerte			0,23
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2022: 94,96 %)					
237.000	Merrill Lynch International	5,05 %	24.07.2023	237.000	0,70
30.652.828	Merrill Lynch International	5,05 %	24.07.2023	30.652.828	89,85
Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt				30.889.828	90,55

Nominal	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens	
Swap-Kontrakte (30. Juni 2022: (2,82) %)				
33.929.209	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR ¹	21.07.2023	192.143	0,56
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten			192.143	0,56

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Geldmarktinstrumente (30. Juni 2022: 7,59 %)			
2.895.109	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund	2.895.109	8,49
Geldmarktinstrumente insgesamt		2.895.109	8,49

Gesamtanlagen			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		30.889.828	90,55
Geldmarktinstrumente		2.895.109	8,49
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten		192.143	0,56
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		137.160	0,40
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		34.114.240	100,00

Analyse des Gesamtvermögens			% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden			8,47
Einlagen bei Kreditinstituten			90,40
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente			0,56
Sonstige Vermögenswerte			0,57
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Merrill Lynch International.

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,96 %)			
Bermuda (30. Juni 2022: 0,85 %)			
6.395.500	AutoStore Holdings Ltd '144A'	13.998.550	1,34
Bermuda insgesamt		13.998.550	1,34
Kanada (30. Juni 2022: 3,06 %)			
329.945	ATS Corp	15.197.668	1,46
95.481	Novanta Inc	17.578.052	1,68
Kanada insgesamt		32.775.720	3,14
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 2,83 %)			
472.037	Airtac International Group	15.535.264	1,49
164.807	Ambarella Inc	13.789.402	1,32
Cayman-Inseln insgesamt		29.324.666	2,81
China (30. Juni 2022: 1,57 %)			
1.059.359	Estun Automation Co Ltd 'A'	4.077.377	0,39
1.092.309	Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A'	3.933.929	0,38
415.693	Iflytek Co Ltd 'A'	3.883.344	0,37
China insgesamt		11.894.650	1,14
Finnland (30. Juni 2022: 0,91 %)			
215.669	Cargotec Oyj - Class B	11.847.169	1,13
Finnland insgesamt		11.847.169	1,13
Frankreich (30. Juni 2022: 2,10 %)			
278.030	Dassault Systemes SE	12.322.886	1,18
55.766	Schneider Electric SE	10.127.605	0,97
Frankreich insgesamt		22.450.491	2,15

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,96 %) (Fortsetzung)			
Deutschland (30. Juni 2022: 6,48 %)			
391.076	Duerr AG	12.646.395	1,21
347.576	GEA Group AG	14.527.447	1,39
413.676	Jenoptik AG	14.189.603	1,36
251.002	KION Group AG	10.093.921	0,97
123.028	Krones AG	14.912.326	1,43
59.040	Siemens AG	9.825.564	0,94
	Deutschland insgesamt	76.195.256	7,30
Israel (30. Juni 2022: 1,58 %)			
833.322	Stratasys Ltd	14.799.799	1,42
	Israel insgesamt	14.799.799	1,42
Japan (30. Juni 2022: 22,32 %)			
754.104	Daifuku Co Ltd	15.352.342	1,47
252.534	Daihen Corp	9.679.580	0,93
491.655	FANUC Corp	17.117.014	1,64
905.002	Fuji Corp/Aichi	15.913.531	1,52
532.369	Harmonic Drive Systems Inc	16.980.114	1,63
32.898	Keyence Corp	15.443.519	1,48
667.473	Mitsubishi Electric Corp	9.360.830	0,90
534.139	Nabtesco Corp	11.674.299	1,12
210.327	Omron Corp	12.759.172	1,22
561.308	Optex Group Co Ltd	7.844.757	0,75
287.613	Shibaura Machine Co Ltd	9.641.158	0,92
26.169	SMC Corp	14.390.368	1,38
588.375	THK Co Ltd	11.988.543	1,15
204.862	Toyota Industries Corp	14.535.299	1,39
345.256	Yaskawa Electric Corp	15.725.049	1,51
690.249	Yokogawa Electric Corp	12.657.866	1,21
	Japan insgesamt	211.063.441	20,22

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,96 %) (Fortsetzung)			
Jersey (30. Juni 2022: 0,95 %)			
109.576	Aptiv Plc	11.186.614	1,07
	Jersey insgesamt	11.186.614	1,07
Niederlande (30. Juni 2022: – %)			
271.247	QIAGEN NV	12.214.252	1,17
	Niederlande insgesamt	12.214.252	1,17
Südkorea (30. Juni 2022: 1,12 %)			
907.728	Koh Young Technology Inc	10.609.047	1,02
	Südkorea insgesamt	10.609.047	1,02
Schweden (30. Juni 2022: 2,34 %)			
1.373.795	Elektro AB	10.599.790	1,01
1.323.221	Hexagon AB	16.262.555	1,56
	Schweden insgesamt	26.862.345	2,57
Schweiz (30. Juni 2022: 4,39 %)			
351.645	ABB Ltd	13.827.771	1,32
76.708	Kardex Holding AG	17.191.230	1,65
35.915	Tecan Group AG	13.777.647	1,32
	Schweiz insgesamt	44.796.648	4,29
Taiwan (30. Juni 2022: 4,76 %)			
941.075	Advantech Co Ltd	12.373.623	1,18
1.020.787	Delta Electronics Inc	11.291.278	1,08
197.753	Global Unichip Corp	10.191.002	0,98
1.957.971	Hiwin Technologies Corp	14.930.990	1,43
	Taiwan insgesamt	48.786.893	4,67

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,96 %) (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 2,41 %)			
2.779.437	Ocado Group Plc	20.071.060	1,92
263.686	Renishaw Plc	13.080.955	1,25
Vereinigtes Königreich insgesamt		33.152.015	3,17
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 40,79 %)			
1.271.922	3D Systems Corp	12.630.185	1,21
55.556	Autodesk Inc	11.367.313	1,09
397.209	Azenta Inc	18.541.716	1,78
56.457	Cadence Design Systems Inc	13.240.296	1,27
304.033	Cognex Corp	17.031.929	1,63
33.490	Deere & Co	13.569.813	1,30
315.666	FARO Technologies Inc	5.113.789	0,49
187.277	Globus Medical Inc	11.150.473	1,07
171.806	GXO Logistics Inc	10.792.853	1,03
74.715	Illumina Inc	14.008.315	1,34
57.694	Intuitive Surgical Inc	19.727.886	1,89
145.546	IPG Photonics Corp	19.768.058	1,89
138.924	iRhythm Technologies Inc	14.492.552	1,39
93.944	John Bean Technologies Corp	11.395.407	1,09
1.817.121	Luminar Technologies Inc - Class A	12.501.792	1,20
72.835	Manhattan Associates Inc	14.558.260	1,39
139.981	Microchip Technology Inc	12.540.898	1,20
233.704	National Instruments Corp	13.414.610	1,28
63.809	Nordson Corp	15.836.118	1,52
35.492	NVIDIA Corp	15.013.826	1,44
194.764	Omniceil Inc	14.348.264	1,37
96.628	PTC Inc	13.750.164	1,32
95.023	QUALCOMM Inc	11.311.538	1,08
56.276	Rockwell Automation Inc	18.540.128	1,78

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,96 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 40,79 %) (Fortsetzung)			
511.209	Samsara Inc	14.165.601	1,36
29.898	ServiceNow Inc	16.801.779	1,61
387.794	Symbotic Inc	16.601.461	1,59
157.913	Teradyne Inc	17.580.454	1,68
236.220	Trimble Inc	12.505.487	1,20
60.897	Zebra Technologies Corp	18.015.160	1,73
Vereinigte Staaten insgesamt		430.316.125	41,22
Stammaktien insgesamt		1.042.273.681	99,83
Gesamtanlagen			
Stammaktien		1.042.273.681	99,83
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.775.505	0,17
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		1.044.049.186	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,74
Sonstige Vermögenswerte			0,26
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

L&G Cyber Security UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,86 %)			
Kanada (30. Juni 2022: 4,70 %)			
22.196.194	BlackBerry Ltd	123.122.168	4,88
Kanada insgesamt		123.122.168	4,88
Frankreich (30. Juni 2022: 0,61 %)			
1.544.579	Atos SE	22.041.708	0,87
Frankreich insgesamt		22.041.708	0,87
Israel (30. Juni 2022: 11,58 %)			
782.198	Check Point Software Technologies Ltd	98.259.713	3,89
3.897.489	Cognyte Software Ltd	23.735.708	0,94
687.159	CyberArk Software Ltd	107.423.566	4,26
2.234.382	Radware Ltd	43.324.667	1,72
Israel insgesamt		272.743.654	10,81
Japan (30. Juni 2022: 5,45 %)			
682.202	Digital Arts Inc	27.517.467	1,09
2.091.721	Trend Micro Inc/Japan	100.508.528	3,98
Japan insgesamt		128.025.995	5,07
Südkorea (30. Juni 2022: 1,32 %)			
483.375	Ahnlab Inc	23.441.477	0,93
Südkorea insgesamt		23.441.477	0,93
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 4,31 %)			
30.441.486	Darktrace Plc	119.278.896	4,73
1.192.786	Softcat Plc	21.472.911	0,85
Vereinigtes Königreich insgesamt		140.751.807	5,58

L&G Cyber Security UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 71,29 %)			
1.233.936	A10 Networks Inc	18.003.126	0,71
1.298.668	Akamai Technologies Inc	116.711.293	4,63
206.211	Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A	23.013.148	0,91
1.945.208	Cisco Systems Inc	100.645.062	3,99
1.649.136	Cloudflare Inc	107.804.020	4,27
740.826	Crowdstrike Holdings Inc	108.805.115	4,31
131.194	F5 Inc	19.188.434	0,76
5.725.550	Fastly Inc	90.291.924	3,58
1.530.029	Fortinet Inc	115.654.892	4,58
5.925.741	Gen Digital Inc	109.922.496	4,36
984.226	Jamf Holding Corp	19.212.092	0,76
2.954.264	Juniper Networks Inc	92.557.091	3,67
2.855.420	Mitek Systems Inc	30.952.753	1,23
1.448.005	N-able Inc	20.865.752	0,83
3.549.241	NetScout Systems Inc	109.849.009	4,35
221.633	Okta Inc	15.370.249	0,61
2.094.063	OneSpan Inc	31.075.895	1,23
509.091	Palo Alto Networks Inc	130.077.841	5,16
427.217	Parsons Corp	20.566.226	0,81
782.078	Qualys Inc	101.021.015	4,00
10.166.845	Rackspace Technology Inc	27.653.818	1,10
416.329	Rapid7 Inc	18.851.377	0,75
6.215.510	SentinelOne Inc	93.854.201	3,72
2.222.520	SolarWinds Corp	22.803.055	0,90
1.060.552	Splunk Inc	112.513.962	4,46
402.308	Tenable Holdings Inc	17.520.513	0,69
734.859	Varonis Systems Inc - Class B	19.583.992	0,78

L&G Cyber Security UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 71,29 %) (Fortsetzung)			
1.302.828	Ziff Davis Inc	91.276.130	3,62
163.602	Zscaler Inc	23.934.973	0,95
Vereinigte Staaten insgesamt		1.809.579.454	71,72
Stammaktien insgesamt		2.519.706.263	99,86
Gesamtanlagen			
Stammaktien		2.519.706.263	99,86
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		3.444.263	0,14
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		2.523.150.526	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			98,50
Sonstige Vermögenswerte			1,50
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 96,06 %)			
Australien (30. Juni 2022: 10,60 %)			
4.196.831	Allkem Ltd	44.754.683	4,29
30.893.766	Core Lithium Ltd	18.508.357	1,77
741.599	Mineral Resources Ltd	35.261.784	3,38
11.865.585	Pilbara Minerals Ltd	38.623.579	3,70
Australien insgesamt		137.148.403	13,14
China (30. Juni 2022: 5,89 %)			
1.175.703	BYD Co Ltd 'H'	37.506.838	3,59
1.429.079	CALB Group Co Ltd 'H' '144A'	3.632.607	0,35
China insgesamt		41.139.445	3,94
Finnland (30. Juni 2022: – %)			
2.479.441	Wartsila OYJ Abp	27.902.967	2,67
Finnland insgesamt		27.902.967	2,67
Frankreich (30. Juni 2022: 5,94 %)			
2.589.330	Bolloré SE	16.130.614	1,55
975.078	Renault SA	41.042.042	3,93
Frankreich insgesamt		57.172.656	5,48
Deutschland (30. Juni 2022: 7,71 %)			
297.401	Bayerische Motoren Werke AG	36.508.966	3,50
479.643	Mercedes-Benz Group AG	38.551.045	3,69
Deutschland insgesamt		75.060.011	7,19
Japan (30. Juni 2022: 22,26 %)			
812.135	GS Yuasa Corp	15.783.629	1,51
2.191.751	NGK Insulators Ltd	25.991.356	2,49
9.491.375	Nissan Motor Co Ltd	38.626.118	3,70

L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 96,06 %) (Fortsetzung)			
Japan (30. Juni 2022: 22,26 %) (Fortsetzung)			
3.560.912	Panasonic Holdings Corp	43.201.012	4,14
2.744.801	Sumitomo Electric Industries Ltd	33.366.414	3,19
972.122	TDK Corp	37.442.850	3,59
1.075.600	Toshiba Corp	33.614.588	3,22
	Japan insgesamt	228.025.967	21,84
Niederlande (30. Juni 2022: 3,26 %)			
635.707	AMG Critical Materials NV	32.937.190	3,16
	Niederlande insgesamt	32.937.190	3,16
Südkorea (30. Juni 2022: 8,81 %)			
562.537	HD Hyundai Electric Co Ltd	27.792.781	2,66
82.559	LG Energy Solution Ltd	34.648.903	3,32
68.075	Samsung SDI Co Ltd	34.563.180	3,31
285.166	Sebang Global Battery Co Ltd	10.442.272	1,00
	Südkorea insgesamt	107.447.136	10,29
Schweiz (30. Juni 2022: 3,92 %)			
980.735	ABB Ltd	38.565.540	3,70
	Schweiz insgesamt	38.565.540	3,70
Taiwan (30. Juni 2022: 7,80 %)			
3.560.359	Delta Electronics Inc	39.382.363	3,77
	Taiwan insgesamt	39.382.363	3,77
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 19,57 %)			
417.131	EnerSys	45.267.056	4,34
8.209.303	Eos Energy Enterprises Inc	35.628.375	3,41
1.051.392	Ivanhoe Electric Inc / US	13.710.152	1,31

L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 96,06 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 19,57 %) (Fortsetzung)			
1.517.966	Livent Corp	41.637.807	3,99
119.982	SolarEdge Technologies Inc	32.281.157	3,09
206.996	Tesla Inc	54.185.343	5,19
Vereinigte Staaten insgesamt		222.709.890	21,33
Stammaktien insgesamt		1.007.491.568	96,51
Vorzugsaktien (30. Juni 2022: 3,70 %)			
Deutschland (30. Juni 2022: 3,70 %)			
251.514	Volkswagen AG - Preference	33.735.158	3,23
Deutschland insgesamt		33.735.158	3,23
Vorzugsaktien Insgesamt		33.735.158	3,23
Gesamtanlagen			
Stammaktien		1.007.491.568	96,51
Vorzugsaktien		33.735.158	3,23
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		2.702.079	0,26
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		1.043.928.805	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,61
Sonstige Vermögenswerte			0,39
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,82 %)			
Australien (30. Juni 2022: 4,53 %)			
121.080	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	1.441.101	3,10
Australien insgesamt		1.441.101	3,10
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 3,40 %)			
6.762	BeiGene Ltd ADR	1.205.665	2,59
304.265	Innovent Biologics Inc '144A'	1.149.255	2,47
1.228.632	SciClone Pharmaceuticals Holdings Ltd '144A'	1.652.476	3,55
40.017	Zai Lab Ltd ADR	1.109.672	2,38
Cayman-Inseln insgesamt		5.117.068	10,99
Dänemark (30. Juni 2022: 3,27 %)			
4.487	Genmab A/S	1.696.217	3,64
Dänemark insgesamt		1.696.217	3,64
Frankreich (30. Juni 2022: 2,74 %)			
14.057	Ipsen SA	1.690.058	3,63
Frankreich insgesamt		1.690.058	3,63
Irland (30. Juni 2022: 6,37 %)			
14.876	Horizon Therapeutics Plc	1.529.996	3,29
11.203	Jazz Pharmaceuticals Plc	1.388.836	2,98
Irland insgesamt		2.918.832	6,27
Japan (30. Juni 2022: 8,37 %)			
65.720	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	1.857.902	3,99
29.500	Eisai Co Ltd	1.984.695	4,26
150.300	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	1.319.616	2,83
77.500	Kyowa Kirin Co Ltd	1.428.443	3,07
37.425	Nippon Shinyaku Co Ltd	1.520.977	3,27
Japan insgesamt		8.111.633	17,42

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,82 %) (Fortsetzung)			
Schweden (30. Juni 2022: 3,68 %)			
71.007	Swedish Orphan Biovitrum AB	1.383.148	2,97
Schweden insgesamt		1.383.148	2,97
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 2,46 %)			
25.024	AstraZeneca Plc ADR	1.790.968	3,85
Vereinigtes Königreich insgesamt		1.790.968	3,85
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 51,79 %)			
8.061	Alnylam Pharmaceuticals Inc	1.531.106	3,29
185.821	BioCryst Pharmaceuticals Inc	1.308.180	2,81
6.038	Biogen Inc	1.719.924	3,69
16.134	BioMarin Pharmaceutical Inc	1.398.495	3,00
321.627	Bluebird Bio Inc	1.058.153	2,27
23.624	Bristol-Myers Squibb Co	1.510.755	3,25
140.402	Emergent BioSolutions Inc	1.031.955	2,22
35.305	Halozyme Therapeutics Inc	1.273.451	2,74
21.108	Incyte Corp	1.313.973	2,82
35.511	PTC Therapeutics Inc	1.444.232	3,10
10.521	Sarepta Therapeutics Inc	1.204.865	2,59
72.277	Travere Therapeutics Inc	1.110.175	2,38
35.822	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	1.652.469	3,55
6.583	United Therapeutics Corp	1.453.197	3,12
5.635	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.983.013	4,26
51.271	Xencor Inc	1.280.237	2,75
Vereinigte Staaten insgesamt		22.274.180	47,84
Stammaktien insgesamt		46.423.205	99,71

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	46.423.205	99,71
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	137.143	0,29
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	46.560.348	100,00

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,65
Sonstige Vermögenswerte	0,35
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,20 %)			
Belgien (30. Juni 2022: 2,59 %)			
452.856	bpost SA	1.988.133	0,78
Belgien insgesamt		1.988.133	0,78
Kanada (30. Juni 2022: 3,78 %)			
86.626	Descartes Systems Group Inc/The	6.947.158	2,73
153.336	Shopify Inc - Class A	9.921.585	3,90
Kanada insgesamt		16.868.743	6,63
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 8,69 %)			
67.748	Alibaba Group Holding Ltd ADR	5.646.796	2,22
4.120.491	JD Logistics Inc '144A'	6.425.294	2,52
460.968	Vipshop Holdings Ltd ADR	7.605.972	2,99
Cayman-Inseln insgesamt		19.678.062	7,73
China (30. Juni 2022: 1,11 %)			
9.512.686	Sinotrans Ltd 'H'	3.386.727	1,33
China insgesamt		3.386.727	1,33
Dänemark (30. Juni 2022: 5,72 %)			
4.136	AP Moller - Maersk A/S - Class B	7.257.075	2,85
38.217	DSV A/S	8.024.322	3,15
71.250	NTG Nordic Transport Group A/S	4.504.755	1,77
Dänemark insgesamt		19.786.152	7,77
Deutschland (30. Juni 2022: 6,17 %)			
152.804	DHL Group	7.456.946	2,93
54.461	SAP SE	7.435.482	2,92
173.568	Zalando SE '144A'	4.991.631	1,96
Deutschland insgesamt		19.884.059	7,81

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,20 %) (Fortsetzung)			
Japan (30. Juni 2022: 18,61 %)			
842.654	Japan Post Holdings Co Ltd	6.042.901	2,37
120.519	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	6.757.435	2,65
1.472.336	Rakuten Group Inc	5.083.167	2,00
514.214	Senko Group Holdings Co Ltd	3.682.232	1,45
Japan insgesamt		21.565.735	8,47
Neuseeland (30. Juni 2022: 2,20 %)			
162.123	Mainfreight Ltd	7.151.428	2,81
Neuseeland insgesamt		7.151.428	2,81
Singapur (30. Juni 2022: – %)			
5.351.854	Mapletree Logistics Trust (Units) (REIT)	6.406.259	2,52
Singapur insgesamt		6.406.259	2,52
Südkorea (30. Juni 2022: 2,45 %)			
107.064	CJ Logistics Corp	6.207.786	2,44
Südkorea insgesamt		6.207.786	2,44
Schweiz (30. Juni 2022: 2,43 %)			
24.133	Kuehne + Nagel International AG	7.140.311	2,80
Schweiz insgesamt		7.140.311	2,80
Taiwan (30. Juni 2022: 1,86 %)			
834.778	Dimerco Express Corp	2.473.953	0,97
Taiwan insgesamt		2.473.953	0,97
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 1,78 %)			
1.082.629	Ocado Group Plc	7.817.954	3,07
719.433	Segro Plc (REIT)	6.556.219	2,58
Vereinigtes Königreich insgesamt		14.374.173	5,65

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,20 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 33,97 %)			
68.198	Amazon.com Inc	8.890.291	3,49
61.656	Concentrix Corp	4.978.722	1,96
159.752	eBay Inc	7.139.317	2,80
66.069	Expeditors International of Washington Inc	8.002.938	3,14
29.989	FedEx Corp	7.434.273	2,92
144.137	GXO Logistics Inc	9.054.686	3,56
45.318	Manhattan Associates Inc	9.058.162	3,56
72.565	Oracle Corp	8.641.766	3,40
56.703	Prologis Inc (REIT)	6.953.489	2,73
83.478	Ryder System Inc	7.078.100	2,78
47.116	SPS Commerce Inc	9.049.099	3,56
74.827	TD SYNEX Corp	7.033.738	2,76
36.910	United Parcel Service Inc - Class B	6.616.118	2,60
46.280	Walmart Inc	7.274.290	2,86
Vereinigte Staaten insgesamt		107.204.989	42,12
Stammaktien insgesamt		254.116.510	99,83
Gesamtanlagen			
Stammaktien		254.116.510	99,83
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		423.120	0,17
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		254.539.630	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,79
Sonstige Vermögenswerte			0,21
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

L&G Clean Water UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,55 %)			
Bermuda (30. Juni 2022: 3,55 %)			
22.258.236	Beijing Enterprises Water Group Ltd	5.282.950	1,19
5.069.911	China Water Affairs Group Ltd	3.829.965	0,86
Bermuda insgesamt		9.112.915	2,05
Brasilien (30. Juni 2022: 2,06 %)			
959.307	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP ADR	11.358.195	2,55
Brasilien insgesamt		11.358.195	2,55
Kanada (30. Juni 2022: 1,21 %)			
616.653	Primo Water Corp	7.732.829	1,74
Kanada insgesamt		7.732.829	1,74
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 2,17 %)			
8.378.884	China Lesso Group Holdings Ltd	5.495.689	1,24
Cayman-Inseln insgesamt		5.495.689	1,24
Finnland (30. Juni 2022: 5,58 %)			
527.644	Kemira Oyj	8.398.924	1,89
869.152	Metso Oyj	10.473.428	2,35
166.296	Uponor Oyj	5.196.156	1,17
Finnland insgesamt		24.068.508	5,41
Deutschland (30. Juni 2022: 1,04 %)			
100.398	Norma Group SE	1.853.330	0,42
Deutschland insgesamt		1.853.330	0,42
Irland (30. Juni 2022: 1,73 %)			
167.781	Pentair Plc	10.838.653	2,44
Irland insgesamt		10.838.653	2,44

L&G Clean Water UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,55 %) (Fortsetzung)			
Japan (30. Juni 2022: 5,61 %)			
366.766	Kitz Corp	2.753.250	0,62
208.571	Kurita Water Industries Ltd	7.928.107	1,78
269.160	METAWATER Co Ltd	3.415.362	0,77
107.800	Nomura Micro Science Co Ltd	5.012.045	1,13
382.492	Organo Corp	11.207.343	2,52
	Japan insgesamt	30.316.107	6,82
Jersey (30. Juni 2022: – %)			
65.383	Ferguson Plc	10.285.400	2,31
	Jersey insgesamt	10.285.400	2,31
Niederlande (30. Juni 2022: 1,82 %)			
188.722	Aalberts NV	7.933.209	1,78
	Niederlande insgesamt	7.933.209	1,78
Schweiz (30. Juni 2022: 3,51 %)			
17.283	Geberit AG	9.042.941	2,03
74.522	Sulzer AG	6.405.643	1,44
	Schweiz insgesamt	15.448.584	3,47
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 8,83 %)			
819.655	Genuit Group Plc	3.058.471	0,69
917.502	Pennon Group Plc	8.293.574	1,87
2.422.980	Rotork Plc	9.389.229	2,11
288.288	Severn Trent Plc	9.404.774	2,11
778.500	United Utilities Group Plc	9.517.397	2,14
	Vereinigtes Königreich insgesamt	39.663.445	8,92
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 58,96 %)			
139.116	A O Smith Corp	10.124.862	2,28
105.616	Advanced Drainage Systems Inc	12.016.988	2,70

L&G Clean Water UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,55 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 58,96 %) (Fortsetzung)			
108.692	American States Water Co	9.456.204	2,13
67.845	American Water Works Co Inc	9.684.874	2,18
100.149	Artesian Resources Corp - Class A	4.729.036	1,06
76.577	Badger Meter Inc	11.299.702	2,54
223.116	Bentley Systems Inc - Class B	12.099.581	2,72
166.747	California Water Service Group	8.609.148	1,94
390.360	Core & Main Inc - Class A	12.233.882	2,75
58.005	Ecolab Inc	10.828.953	2,44
407.477	Energy Recovery Inc	11.388.982	2,56
97.933	Franklin Electric Co Inc	10.077.306	2,27
122.549	Gorman-Rupp Co/The	3.533.088	0,79
41.525	IDEX Corp	8.938.671	2,01
166.953	Itron Inc	12.037.311	2,71
43.086	Kadant Inc	9.569.401	2,15
60.086	Lindsay Corp	7.170.663	1,61
6.283	Mettler-Toledo International Inc	8.241.034	1,85
124.825	Middlesex Water Co	10.068.384	2,26
672.673	Mueller Water Products Inc - Class A	10.917.483	2,46
68.499	Northwest Pipe Co	2.071.410	0,47
22.037	Roper Technologies Inc	10.595.390	2,38
125.070	SJW Group	8.768.658	1,97
175.388	Trimble Inc	9.285.041	2,09
53.454	Watts Water Technologies Inc - Class A	9.821.103	2,21
183.653	Xylem Inc/NY	20.683.001	4,65
89.691	York Water Co/The	3.701.548	0,83
410.123	Zurn Elkay Water Solutions Corp	11.028.207	2,48
	Vereinigte Staaten insgesamt	268.979.911	60,49
	Stammaktien insgesamt	443.086.775	99,64

L&G Clean Water UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	443.086.775	99,64
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.592.267	0,36
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	444.679.042	100,00

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,49
Sonstige Vermögenswerte	0,51
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022 99,88 %)			
Kanada (30. Juni 2022: 1,38 %)			
111.668	Shopify Inc - Class A	7.213.753	1,75
Kanada insgesamt		7.213.753	1,75
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 9,49 %)			
77.242	Alibaba Group Holding Ltd ADR	6.438.120	1,57
87.222	Ambarella Inc	7.297.865	1,78
138.967	JD.com Inc ADR	4.742.944	1,15
Cayman-Inseln insgesamt		18.478.929	4,50
China (30. Juni 2022: 0,40 %)			
172.698	Iflytek Co Ltd 'A'	1.613.320	0,39
China insgesamt		1.613.320	0,39
Frankreich (30. Juni 2022: 1,45 %)			
125.085	Dassault Systemes SE	5.544.035	1,35
Frankreich insgesamt		5.544.035	1,35
Deutschland (30. Juni 2022: 1,08 %)			
128.210	Infineon Technologies AG	5.285.289	1,29
Deutschland insgesamt		5.285.289	1,29
Irland (30. Juni 2022: 1,12 %)			
16.344	Accenture Plc - Class A	5.043.432	1,23
Irland insgesamt		5.043.432	1,23
Israel (30. Juni 2022: 4,30 %)			
226.295	JFrog Ltd	6.268.372	1,52
22.215	Nice Ltd ADR	4.587.397	1,12
Israel insgesamt		10.855.769	2,64

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022 99,88 %) (Fortsetzung)			
Luxemburg (30. Juni 2022: 1,06 %)			
29.696	Spotify Technology SA	4.767.693	1,16
Luxemburg insgesamt		4.767.693	1,16
Niederlande (30. Juni 2022: 1,32 %)			
10.130	ASML Holding NV NY Reg Shrs	7.341.717	1,79
Niederlande insgesamt		7.341.717	1,79
Taiwan (30. Juni 2022: 3,82 %)			
146.604	Global Unichip Corp	7.555.089	1,84
250.579	MediaTek Inc	5.535.436	1,35
309.795	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	5.729.486	1,39
Taiwan insgesamt		18.820.011	4,58
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 2,81 %)			
1.400.937	Darktrace Plc	5.489.292	1,33
Vereinigtes Königreich insgesamt		5.489.292	1,33
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 69,66 %)			
10.897	Adobe Inc	5.328.524	1,30
67.972	Advanced Micro Devices Inc	7.742.691	1,88
63.588	Alphabet Inc - Class A	7.611.484	1,85
197.050	Alteryx Inc - Class A	8.946.070	2,18
53.727	Amazon.com Inc	7.003.852	1,70
43.626	Analog Devices Inc	8.498.781	2,07
43.134	Arista Networks Inc	6.990.296	1,70
32.215	Atlassian Corp	5.405.999	1,32
36.362	Autodesk Inc	7.440.029	1,81
77.585	Block Inc	5.164.833	1,26
2.001	Booking Holdings Inc	5.403.360	1,31
2.086.281	Butterfly Network Inc	4.798.446	1,17
150.032	C3.ai Inc	5.465.666	1,33

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022 99,88 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 69,66 %) (Fortsetzung)			
111.047	Cloudflare Inc	7.259.142	1,77
129.129	Cognex Corp	7.233.807	1,76
63.185	CoStar Group Inc	5.623.465	1,37
47.427	CrowdStrike Holdings Inc	6.965.604	1,69
50.690	Datadog Inc	4.986.882	1,21
50.984	Electronic Arts Inc	6.612.625	1,61
72.641	Etsy Inc	6.146.155	1,50
8.227	Fair Isaac Corp	6.657.371	1,62
38.096	Fiserv Inc	4.805.810	1,17
259.767	Gen Digital Inc	4.818.678	1,17
12.577	HubSpot Inc	6.692.096	1,63
29.381	Illumina Inc	5.508.644	1,34
46.001	International Business Machines Corp	6.155.394	1,50
11.629	Intuit Inc	5.328.292	1,30
11.285	Lam Research Corp	7.254.675	1,76
357.646	Lemonade Inc	6.026.335	1,47
4.530	MercadoLibre Inc	5.366.238	1,31
24.880	Microsoft Corp	8.472.635	2,06
16.410	MongoDB Inc - Class A	6.744.346	1,64
88.065	New Relic Inc	5.762.974	1,40
21.216	NVIDIA Corp	8.974.792	2,18
37.644	Palo Alto Networks Inc	9.618.418	2,34
204.668	Pure Storage Inc	7.535.876	1,83
154.695	Rapid7 Inc	7.004.590	1,70
19.583	Salesforce Inc	4.137.105	1,01
281.488	Samsara Inc	7.800.032	1,90
13.394	ServiceNow Inc	7.527.026	1,83
31.910	Snowflake Inc	5.615.522	1,37
81.111	Splunk Inc	8.605.066	2,09
55.783	Teradyne Inc	6.210.321	1,51
28.856	Tesla Inc	7.553.635	1,84

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022 99,88 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 69,66 %) (Fortsetzung)			
96.933	Twilio Inc - Class A	6.166.877	1,50
230.055	Varonis Systems Inc - Class B	6.130.966	1,49
33.380	Veeva Systems Inc - Class A	6.600.227	1,61
193.634	Veracyte Inc	4.931.858	1,20
23.746	Verisk Analytics Inc - Class A	5.367.308	1,31
Vereinigte Staaten insgesamt		320.000.818	77,87
Stammaktien insgesamt		410.454.058	99,88
Gesamtanlagen			
Stammaktien		410.454.058	99,88
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		487.011	0,12
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		410.941.069	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,84
Sonstige Vermögenswerte			0,16
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,85 %)			
Kanada (30. Juni 2022: 0,95 %)			
8.996	Novanta Inc	1.656.164	1,34
Kanada insgesamt		1.656.164	1,34
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 1,54 %)			
249.282	JD Health International Inc '144A'	1.573.005	1,28
Cayman-Inseln insgesamt		1.573.005	1,28
Deutschland (30. Juni 2022: 1,32 %)			
33.950	Siemens Healthineers AG '144A'	1.920.877	1,56
Deutschland insgesamt		1.920.877	1,56
Italien (30. Juni 2022: 1,56 %)			
19.473	DiaSorin SpA	2.026.789	1,64
Italien insgesamt		2.026.789	1,64
Japan (30. Juni 2022: 0,79 %)			
38.574	Terumo Corp	1.217.522	0,99
Japan insgesamt		1.217.522	0,99
Jersey (30. Juni 2022: 1,40 %)			
22.251	Novocure Ltd	923.416	0,75
Jersey insgesamt		923.416	0,75
Luxemburg (30. Juni 2022: 1,07 %)			
27.100	Eurofins Scientific SE	1.719.575	1,39
Luxemburg insgesamt		1.719.575	1,39
Niederlande (30. Juni 2022: 1,18 %)			
100.060	Koninklijke Philips NV	2.162.362	1,75
45.320	QIAGEN NV	2.040.760	1,66
Niederlande insgesamt		4.203.122	3,41

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2021: 99,85 %) (Fortsetzung)			
Schweiz (30. Juni 2022: 3,85 %)			
2.850	Lonza Group AG	1.699.221	1,38
4.928	Roche Holding AG	1.506.537	1,22
4.770	Tecan Group AG	1.829.859	1,48
	Schweiz insgesamt	5.035.617	4,08
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 2,11 %)			
94.915	Smith & Nephew Plc	1.530.098	1,24
	Vereinigtes Königreich insgesamt	1.530.098	1,24
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 80,14 %)			
146.409	3D Systems Corp	1.453.841	1,18
16.577	Abbott Laboratories	1.807.225	1,47
15.145	Agilent Technologies Inc	1.821.186	1,48
5.545	Align Technology Inc	1.960.934	1,59
10.877	Alnylam Pharmaceuticals Inc	2.065.977	1,68
42.842	Avanos Medical Inc	1.095.042	0,89
119.144	Axogen Inc	1.087.785	0,88
47.647	Azenta Inc	2.224.162	1,80
30.453	Baxter International Inc	1.387.439	1,13
6.065	Becton Dickinson & Co	1.601.221	1,30
15.568	BioMarin Pharmaceutical Inc	1.349.434	1,10
4.950	Bio-Rad Laboratories Inc	1.876.644	1,52
39.633	Boston Scientific Corp	2.143.749	1,74
22.778	Bristol-Myers Squibb Co	1.456.653	1,18
570.502	Butterfly Network Inc	1.312.155	1,06
233.188	CareDx Inc	1.982.098	1,61
545.259	Cerus Corp	1.341.337	1,09
10.497	Charles River Laboratories International Inc	2.206.994	1,79
528.620	Codexis Inc	1.480.136	1,20
10.382	CONMED Corp	1.410.810	1,14
8.754	Danaher Corp	2.100.960	1,70

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2021: 99,85 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)			
17.186	Dexcom Inc	2.208.573	1,79
21.351	Edwards Lifesciences Corp	2.014.040	1,63
19.095	Exact Sciences Corp	1.793.020	1,45
48.052	Fulgent Genetics Inc	1.779.366	1,44
20.546	GE HealthCare Technologies Inc	1.669.157	1,35
21.903	Globus Medical Inc	1.304.105	1,06
59.832	Guardant Health Inc	2.141.986	1,74
140.431	Health Catalyst Inc	1.755.387	1,42
21.448	Hologic Inc	1.736.645	1,41
9.755	Illumina Inc	1.828.965	1,48
28.966	Incyte Corp	1.803.133	1,46
7.496	Insulet Corp	2.161.397	1,75
50.850	Integra LifeSciences Holdings Corp	2.091.460	1,70
6.748	Intuitive Surgical Inc	2.307.411	1,87
9.572	IQVIA Holdings Inc	2.151.498	1,75
18.740	iRhythm Technologies Inc	1.954.957	1,59
8.772	Masimo Corp	1.443.433	1,17
7.748	Medpace Holdings Inc	1.860.837	1,51
15.495	Moderna Inc	1.882.643	1,53
43.156	Natera Inc	2.099.971	1,70
56.629	Nevro Corp	1.439.509	1,17
25.626	Omnicell Inc	1.887.867	1,53
6.303	Penumbra Inc	2.168.610	1,76
56.393	Privia Health Group Inc	1.472.421	1,19
19.436	QuidelOrtho Corp	1.610.467	1,31
2.619	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.881.856	1,53
17.551	Revvity Inc	2.084.883	1,69
35.047	STAAR Surgical Co	1.842.421	1,49
7.569	Stryker Corp	2.309.226	1,87
58.538	Tactile Systems Technology Inc	1.459.352	1,18
47.327	Teladoc Health Inc	1.198.320	0,97

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2021: 99,85 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)			
4.050	Thermo Fisher Scientific Inc	2.113.088	1,71
98.155	Twist Bioscience Corp	2.008.251	1,63
7.940	Veeva Systems Inc - Class A	1.569.976	1,27
60.309	Veracyte Inc	1.536.070	1,25
5.049	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.776.794	1,44
Vereinigte Staaten insgesamt		101.512.877	82,32
Stammaktien insgesamt		123.319.062	100,00
Gesamtanlagen			
Stammaktien		123.319.062	100,00
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		(3.015)	0,00
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		123.316.047	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,96
Sonstige Vermögenswerte			0,04
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %)			
Österreich (30. Juni 2022: 0,31 %)			
12.847	ams-OSRAM AG	84.791	0,02
4.278	BAWAG Group AG '144A'	180.617	0,04
16.758	Erste Group Bank AG	537.764	0,14
3.198	Verbund AG	234.893	0,06
Österreich insgesamt		1.038.065	0,26
Belgien (30. Juni 2022: 1,45 %)			
1.094	Ackermans & van Haaren NV	164.975	0,04
1.788	Aedifica SA (REIT)	104.956	0,03
7.579	Ageas SA/NV	281.257	0,07
41.717	Anheuser-Busch InBev SA/NV	2.162.192	0,55
3.713	Azelis Group NV	77.527	0,02
1.452	Cofinimmo SA (REIT)	99.898	0,03
1.077	D'iereeren Group	174.366	0,04
1.377	Elia Group SA/NV	160.145	0,04
4.641	Groupe Bruxelles Lambert NV	334.894	0,08
12.400	KBC Group NV	792.608	0,20
19	Lotus Bakeries NV	138.130	0,04
750	Sofina SA	142.275	0,04
6.005	UCB SA	487.606	0,12
7.866	Warehouses De Pauw CVA (REIT)	197.594	0,05
Belgien insgesamt		5.318.423	1,35
Bermuda (30. Juni 2022: 0,07 %)			
16.288	Hiscox Ltd	207.076	0,05
Bermuda insgesamt		207.076	0,05
Dänemark (30. Juni 2022: 4,62 %)			
7.586	Ambu A/S - Class B	113.750	0,03
231	AP Moller - Maersk A/S - Class B	371.506	0,09

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Dänemark (30. Juni 2022: 4,62 %) (Fortsetzung)			
3.530	Bavarian Nordic A/S	91.972	0,02
4.575	Carlsberg AS	670.031	0,17
4.874	Chr Hansen Holding A/S	310.010	0,08
6.018	Coloplast A/S	689.575	0,17
29.396	Danske Bank A/S	655.352	0,17
4.277	Demant A/S	165.716	0,04
8.668	DSV A/S	1.668.181	0,42
3.293	Genmab A/S	1.141.010	0,29
5.787	GN Store Nord AS	132.279	0,03
7.706	ISS A/S	149.287	0,04
2.298	Jyske Bank A/S	159.990	0,04
2.580	NKT A/S	143.380	0,04
79.556	Novo Nordisk A/S	11.746.455	2,98
9.776	Novozymes A/S	417.378	0,11
4.323	Pandora A/S	353.690	0,09
1.307	Ringkjoebing Landbobank A/S	171.582	0,04
437	ROCKWOOL A/S	103.469	0,03
1.906	Royal Unibrew A/S	156.146	0,04
1.853	SimCorp A/S	179.925	0,05
2.497	Sydbank AS	105.702	0,03
2.180	Topdanmark AS	98.138	0,02
17.626	Tryg A/S	349.515	0,09
48.947	Vestas Wind Systems A/S	1.192.848	0,30
	Dänemark insgesamt	21.336.887	5,41
Färöer-Inseln (30. Juni 2022: 0,04 %)			
2.358	Bakkafrost P/F	129.514	0,03
	Färöer Inseln insgesamt	129.514	0,03
Finnland (30. Juni 2022: 2,01 %)			
6.686	Elisa Oyj	327.213	0,08

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Finnland (30. Juni 2022: 2,01 %) (Fortsetzung)			
4.736	Huhtamaki Oyj	142.364	0,04
12.944	Kesko Oyj	223.284	0,06
7.313	Kojamo Oyj	63.038	0,02
15.327	Kone Oyj - Class B	733.090	0,19
33.390	Metso Oyj	368.793	0,09
264.343	Nokia Oyj	1.013.888	0,26
148.152	Nordea Bank Abp	1.476.483	0,37
5.138	Orion Oyj	195.347	0,05
22.920	Sampo Oyj - Class A	942.470	0,24
27.860	Stora Enso Oyj	296.012	0,07
4.580	TietoEVRY Oyj	115.782	0,03
23.607	UPM-Kymmene Oyj	643.763	0,16
7.620	Valmet Oyj	194.158	0,05
23.557	Wartsila OYJ Abp	242.990	0,06
	Finnland insgesamt	6.978.675	1,77
Frankreich (30. Juni 2022: 15,97 %)			
7.978	Accor SA	271.412	0,07
1.295	Aeroports de Paris	170.292	0,04
40.899	Air France-KLM	70.469	0,02
25.603	Air Liquide SA	4.204.013	1,06
15.155	Alstom SA	414.035	0,10
1.365	Alten SA	196.970	0,05
2.970	Amundi SA '144A'	160.529	0,04
95.785	AXA SA	2.588.590	0,66
1.881	BioMerieux	180.802	0,05
51.222	BNP Paribas SA	2.956.534	0,75
10.011	Bouygues SA	307.938	0,08
13.793	Bureau Veritas SA	346.480	0,09
7.804	Capgemini SE	1.354.384	0,34
28.229	Carrefour SA	489.914	0,12

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Frankreich (30. Juni 2022: 15,97 %) (Fortsetzung)			
190	Christian Dior SE	154.470	0,04
21.885	Cie de Saint-Gobain	1.219.651	0,31
32.745	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	886.080	0,22
2.862	Covivio SA/France (REIT)	123.581	0,03
55.648	Credit Agricole SA	605.005	0,15
31.299	Danone SA	1.757.126	0,44
32.709	Dassault Systemes SE	1.328.803	0,34
12.110	Edenred	742.827	0,19
3.925	Eiffage SA	375.151	0,09
9.371	Elis SA	166.804	0,04
14.375	EssilorLuxottica SA	2.481.125	0,63
1.917	Eurazeo SE	123.551	0,03
2.711	Gecina SA (REIT)	264.458	0,07
17.800	Getlink SE	277.324	0,07
1.543	Hermes International	3.070.570	0,78
1.708	Ipsen SA	188.222	0,05
3.426	Kering SA	1.732.186	0,44
10.259	Klepierre SA (REIT)	233.084	0,06
5.314	La Francaise des Jeux SAEM '144A'	191.517	0,05
12.875	Legrand SA	1.169.050	0,30
11.645	L'Oreal SA	4.973.579	1,26
12.478	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	10.768.514	2,73
1.145	Nexans SA	90.856	0,02
96.146	Orange SA	1.028.954	0,26
10.061	Pernod Ricard SA	2.036.346	0,52
10.991	Publicis Groupe SA	807.838	0,20
1.063	Remy Cointreau SA	156.208	0,04
9.366	Renault SA	361.340	0,09
54.355	Sanofi	5.337.661	1,35
1.148	Sartorius Stedim Biotech	262.548	0,07
26.138	Schneider Electric SE	4.350.931	1,10

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Frankreich (30. Juni 2022: 15,97 %) (Fortsetzung)			
7.354	SCOR SE	197.749	0,05
1.216	SEB SA	115.094	0,03
32.774	Societe Generale SA	780.021	0,20
4.047	Sodexo SA	408.140	0,10
1.213	SOITEC	187.954	0,05
692	Sopra Steria Group SACA	126.498	0,03
6.153	SPIE SA	182.129	0,05
2.973	Teleperformance	456.207	0,11
4.005	Ubisoft Entertainment SA	103.649	0,03
31.389	Veolia Environnement SA	908.712	0,23
4.197	Verallia SA '144A'	144.293	0,04
25.505	Vinci SA	2.713.222	0,69
34.257	Vivendi SE	287.964	0,07
1.218	Wendel SE	114.492	0,03
11.008	Worldline SA/France '144A'	368.768	0,09
Frankreich insgesamt		68.072.614	17,24
Deutschland (30. Juni 2022: 10,00 %)			
7.612	adidas AG	1.353.261	0,34
5.739	AIXTRON SE	178.426	0,05
19.155	Allianz SE	4.083.846	1,04
47.567	Bayer AG	2.410.220	0,61
14.688	Bayerische Motoren Werke AG	1.652.694	0,42
3.953	Bechtle AG	143.573	0,04
4.719	Beiersdorf AG	572.179	0,15
7.520	Brenntag SE	536.928	0,14
1.659	Carl Zeiss Meditec AG	164.307	0,04
48.431	Commerzbank AG	491.575	0,12
2.744	CTS Eventim AG & Co KGaA	158.740	0,04
8.334	Delivery Hero SE '144A'	336.735	0,09
91.271	Deutsche Bank AG	877.845	0,22

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Deutschland (30. Juni 2022: 10,00 %) (Fortsetzung)			
9.037	Deutsche Boerse AG	1.528.157	0,39
26.568	Deutsche Lufthansa AG	249.181	0,06
176.397	Deutsche Telekom AG	3.523.706	0,89
47.815	DHL Group	2.138.765	0,54
5.809	Encavis AG	87.280	0,02
6.433	Evotec SE	132.584	0,03
5.240	Freenet AG	120.415	0,03
9.301	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	407.105	0,10
20.673	Fresenius SE & Co KGaA	524.474	0,13
7.491	GEA Group AG	286.980	0,07
1.612	Gerresheimer AG	166.197	0,04
3.012	Hannover Rueck SE	585.382	0,15
8.478	HelloFresh SE	191.603	0,05
2.724	HUGO BOSS AG	194.875	0,05
61.564	Infineon Technologies AG	2.326.196	0,59
3.760	KION Group AG	138.594	0,04
3.243	Knorr-Bremse AG	226.945	0,06
3.056	LEG Immobilien SE	160.868	0,04
39.929	Mercedes-Benz Group AG	2.941.569	0,75
6.069	Merck KGaA	919.757	0,23
7.043	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	2.419.975	0,61
2.653	Nemetschek SE	182.102	0,05
5.158	Puma SE	284.309	0,07
252	Rational AG	167.076	0,04
50.543	SAP SE	6.324.951	1,60
3.889	Scout24 SE '144A'	225.873	0,06
35.816	Siemens AG	5.463.373	1,38
14.123	Siemens Healthineers AG '144A'	732.419	0,19
6.708	Symrise AG - Class A	644.102	0,16
2.447	Talanx AG	128.590	0,03
43.699	Telefonica Deutschland Holding AG	112.612	0,03

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Deutschland (30. Juni 2022: 10,00 %) (Fortsetzung)			
35.362	Vonovia SE	632.803	0,16
10.864	Zalando SE '144A'	286.375	0,07
Deutschland insgesamt		47.415.522	12,01
International (30. Juni 2022: 0,08 %)			
5.353	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	257.747	0,07
International insgesamt		257.747	0,07
Irland (30. Juni 2022: 2,84 %)			
55.537	AIB Group Plc	213.817	0,05
48.701	Bank of Ireland Group Plc	425.549	0,11
35.263	CRH Plc	1.780.782	0,45
8.506	Flutter Entertainment Plc	1.567.231	0,40
10.807	Grafton Group Plc	98.443	0,02
7.272	Kerry Group Plc	649.971	0,16
7.121	Kingspan Group Plc	433.669	0,11
27.000	Ryanair Holdings Plc	464.805	0,12
12.365	Smurfit Kappa Group Plc	377.503	0,10
Irland insgesamt		6.011.770	1,52
Isle of Man (30. Juni 2022: 0,11 %)			
28.877	Entain Plc	428.033	0,11
Isle of Man insgesamt		428.033	0,11
Italien (30. Juni 2022: 2,60 %)			
5.218	Amplifon SpA	175.273	0,05
48.778	Assicurazioni Generali SpA	908.246	0,23
6.144	Azimut Holding SpA	121.375	0,03
68.703	Banco BPM SpA	291.988	0,07
49.626	BPER Banca	138.060	0,04
1.635	Brunello Cucinelli SpA	131.781	0,03

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Italien (30. Juni 2022: 2,60 %) (Fortsetzung)			
1.204	DiaSorin SpA	114.862	0,03
370.493	Enel SpA	2.285.201	0,58
30.327	FinecoBank Banca Fineco SpA	373.477	0,10
14.193	Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A'	171.451	0,04
3.281	Interpump Group SpA	166.937	0,04
746.650	Intesa Sanpaolo SpA	1.791.960	0,45
28.266	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	309.795	0,08
9.821	Moncler SpA	622.062	0,16
27.234	Nexi SpA '144A'	195.595	0,05
22.056	Poste Italiane SpA '144A'	218.707	0,06
12.270	Prysmian SpA	469.696	0,12
4.800	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	210.000	0,05
1.065	Reply SpA	110.866	0,03
465.695	Telecom Italia SpA/Milano	120.056	0,03
65.712	Terna - Rete Elettrica Nazionale	512.948	0,13
89.771	UniCredit SpA	1.908.980	0,48
	Italien insgesamt	11.349.316	2,88
Jersey (30. Juni 2022: 0,96 %)			
44.005	Experian Plc	1.547.601	0,39
60.724	Man Group Plc/Jersey	154.614	0,04
52.325	WPP Plc	502.063	0,13
	Jersey insgesamt	2.204.278	0,56
Luxemburg (30. Juni 2022: 0,29 %)			
17.865	Allegro.eu SA '144A'	128.969	0,03
43.134	B&M European Value Retail SA	279.971	0,07
5.799	Eurofins Scientific SE	337.270	0,09
9.941	InPost SA	98.774	0,02
7.511	Millicom International Cellular SA SDR	105.070	0,03

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Luxemburg (30. Juni 2022: 0,29 %) (Fortsetzung)			
17.124	SES SA Receipt - Class A	92.384	0,02
Luxemburg insgesamt		1.042.438	0,26
Malta (30. Juni 2022: 0,02 %)			
10.575	Kindred Group Plc SDR	103.064	0,03
Malta insgesamt		103.064	0,03
Niederlande (30. Juni 2022: 8,61 %)			
4.760	Aalberts NV	183.403	0,05
20.015	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A'	284.813	0,07
1.401	Adyen NV '144A'	2.221.706	0,56
68.107	Aegon NV	315.335	0,08
8.390	Akzo Nobel NV	626.901	0,16
3.255	Arcadis NV	124.601	0,03
2.695	Argenx SE	957.803	0,24
2.346	ASM International NV	911.069	0,23
19.998	ASML Holding NV	13.258.674	3,36
7.013	ASR Nederland NV	289.216	0,07
4.136	BE Semiconductor Industries NV	410.705	0,10
47.546	CNH Industrial NV	627.845	0,16
24.566	Davide Campari-Milano NV	311.743	0,08
4.238	Euronext NV '144A'	264.027	0,07
5.118	EXOR NV	418.038	0,11
5.994	Ferrari NV	1.795.203	0,45
24.019	Ferrovial SE	695.830	0,18
5.090	Heineken Holding NV	405.419	0,10
11.815	Heineken NV	1.112.737	0,28
2.674	IMCD NV	352.166	0,09
167.596	ING Groep NV	2.067.799	0,52
5.125	JDE Peet's NV	139.708	0,04
8.669	Just Eat Takeaway.com NV '144A'	121.678	0,03

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Niederlande (30. Juni 2022: 8,61 %) (Fortsetzung)			
47.742	Koninklijke Ahold Delhaize NV	1.492.415	0,38
2.025	Koninklijke DSM NV	230.951	0,06
153.603	Koninklijke KPN NV	502.128	0,13
42.435	Koninklijke Philips NV	840.552	0,21
12.113	NN Group NV	410.752	0,10
37.141	Prosus NV	2.492.533	0,63
10.544	QIAGEN NV	433.780	0,11
5.542	Randstad NV	267.734	0,07
5.866	Signify NV '144A'	150.580	0,04
30.508	STMicroelectronics NV	1.389.945	0,35
38.830	Universal Music Group NV	790.191	0,20
12.147	Wolters Kluwer NV	1.412.696	0,36
Niederlande insgesamt		38.310.676	9,70
Norwegen (30. Juni 2022: 0,82 %)			
40.527	DNB Bank ASA	695.873	0,18
9.291	Gjensidige Forsikring ASA	136.560	0,03
20.600	Mowi ASA	299.961	0,08
72.178	NEL ASA	77.745	0,02
7.328	Nordic Semiconductor ASA	81.784	0,02
35.602	Orkla ASA	234.837	0,06
3.069	Salmar ASA	113.664	0,03
23.763	Storebrand ASA	170.082	0,04
30.192	Telenor ASA	281.034	0,07
11.423	TOMRA Systems ASA	168.581	0,04
Norwegen insgesamt		2.260.121	0,57
Polen (30. Juni 2022: 0,29 %)			
8.855	Bank Polska Kasa Opieki SA	221.341	0,06
2.114	Dino Polska SA '144A'	226.438	0,06
7.089	KGHM Polska Miedz SA	179.757	0,04

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Polen (30. Juni 2022: 0,29 %) (Fortsetzung)			
50	LPP SA	158.031	0,04
42.610	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	347.499	0,09
27.452	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	244.070	0,06
1.265	Santander Bank Polska SA	111.013	0,03
	Polen insgesamt	1.488.149	0,38
Portugal (30. Juni 2022: 0,22 %)			
141.430	EDP - Energias de Portugal SA	633.041	0,16
12.784	Jeronimo Martins SGPS SA	322.668	0,08
	Portugal insgesamt	955.709	0,24
Spanien (30. Juni 2022: 4,26 %)			
1.177	Acciona SA	182.906	0,05
10.409	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	334.857	0,09
3.702	Aena SME SA '144A'	547.896	0,14
22.339	Amadeus IT Group SA	1.557.028	0,39
276.517	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1.944.468	0,49
256.412	Banco de Sabadell SA	270.258	0,07
766.398	Banco Santander SA	2.594.257	0,66
29.690	Bankinter SA	167.155	0,04
188.836	CaixaBank SA	715.122	0,18
26.821	Cellnex Telecom SA '144A'	992.109	0,25
2.758	Corp ACCIONA Energias Renovables SA	84.450	0,02
11.062	EDP Renovaveis SA	202.379	0,05
15.819	Grifols SA	185.715	0,05
288.625	Iberdrola SA	3.449.069	0,87
50.640	Industria de Diseno Textil SA	1.795.694	0,46
13.992	Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT)	77.586	0,02
120.291	International Consolidated Airlines Group SA	226.943	0,06
15.638	Merlin Properties Socimi SA (REIT)	122.602	0,03
18.869	Redeia Corp SA	290.300	0,07

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Spanien (30. Juni 2022: 4,26 %) (Fortsetzung)			
245.665	Telefonica SA	912.891	0,23
927	Vidrala SA	80.185	0,02
1.652	Viscofan SA	104.572	0,03
Spanien insgesamt		16.838.442	4,27
Schweden (30. Juni 2022: 5,04 %)			
12.813	AddTech AB	255.296	0,06
46.893	Assa Abloy AB	1.030.629	0,26
123.536	Atlas Copco AB	1.629.067	0,41
5.954	Avanza Bank Holding AB	110.902	0,03
5.220	Axfood AB	101.084	0,03
16.587	Beijer Ref AB - Class B	193.678	0,05
11.481	Billerud Aktiebolag	79.850	0,02
11.783	Boliden AB	311.514	0,08
15.617	Castellum AB	136.433	0,03
16.611	Elektro AB	117.475	0,03
34.666	Embracer Group AB - Class B	79.308	0,02
27.394	Epiroc AB	473.988	0,12
17.102	EQT AB	300.989	0,08
29.356	Essity AB	715.195	0,18
8.909	Evolution AB '144A'	1.032.549	0,26
13.294	Fabege AB	87.496	0,02
32.040	Fastighets AB Balder - Class B	107.014	0,03
23.262	Fortnox AB	125.703	0,03
10.540	Gefinge AB	168.998	0,04
30.271	H & M Hennes & Mauritz AB	475.680	0,12
96.759	Hexagon AB	1.089.985	0,28
12.562	Hexpol AB	121.843	0,03
4.457	Holmen AB	146.520	0,04
20.233	Husqvarna AB	167.642	0,04
7.688	Industrivarden AB	193.891	0,05

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Schweden (30. Juni 2022: 5,04 %) (Fortsetzung)			
13.479	Indutrade AB	277.830	0,07
6.779	Investment AB Latour	122.989	0,03
87.629	Investor AB	1.603.584	0,41
11.472	Kinnevik AB	145.440	0,04
3.647	L E Lundbergforetagen AB	141.989	0,04
11.122	Lifco AB	221.131	0,06
72.230	Nibe Industrier AB	627.642	0,16
7.990	Nordnet AB publ	97.838	0,02
9.439	Sagax AB	170.608	0,04
45.650	Sandvik AB	814.269	0,21
6.360	Sectra AB	97.631	0,02
23.662	Securitas AB	177.620	0,04
78.822	Skandinaviska Enskilda Banken AB	796.959	0,20
17.021	Skanska AB	218.317	0,06
17.616	SKF AB	280.436	0,07
29.458	Svenska Cellulosa AB SCA - Class B	343.592	0,09
71.300	Svenska Handelsbanken AB	546.593	0,14
9.840	Sweco AB	99.115	0,02
44.308	Swedbank AB	683.738	0,17
8.629	Swedish Orphan Biovitrum AB	154.064	0,04
25.632	Tele2 AB	193.844	0,05
140.656	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	697.172	0,18
115.295	Telia Co AB	231.385	0,06
5.258	Thule Group AB '144A'	141.485	0,04
9.063	Trelleborg AB	201.035	0,05
25.511	Volvo Car AB	92.698	0,02
14.282	Wihlborgs Fastigheter AB	94.532	0,02
	Schweden insgesamt	18.526.265	4,69
Schweiz (30. Juni 2022: 18,41 %)			
74.270	ABB Ltd	2.676.910	0,68

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Schweiz (30. Juni 2022: 18,41 %) (Fortsetzung)			
7.554	Adecco Group AG	226.220	0,06
24.035	Alcon Inc	1.824.681	0,46
660	Allreal Holding AG	102.240	0,03
1.538	Bachem Holding AG	122.907	0,03
2.286	Baloise Holding AG	307.749	0,08
1.330	Banque Cantonale Vaudoise	128.768	0,03
167	Barry Callebaut AG	295.484	0,08
502	Belimo Holding AG	229.487	0,06
969	BKW AG	156.857	0,04
319	Bucher Industries AG	129.096	0,03
1.374	Cembra Money Bank AG	104.452	0,03
49	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	564.270	0,14
25.114	Cie Financiere Richemont SA	3.901.960	0,99
10.307	Clariant AG	136.433	0,03
9.554	Coca-Cola HBC AG	261.075	0,07
1.632	DKSH Holding AG	111.274	0,03
6.509	DSM-Firmenich AG	641.918	0,16
4.103	Dufry AG	171.340	0,04
325	EMS-Chemie Holding AG	225.422	0,06
870	Flughafen Zurich AG	165.700	0,04
2.345	Galenica AG '144A'	173.582	0,04
1.594	Geberit AG	764.454	0,19
3.771	Georg Fischer AG	259.434	0,07
454	Givaudan SA	1.379.130	0,35
1.613	Helvetia Holding AG	199.960	0,05
10.118	Julius Baer Group Ltd	584.031	0,15
2.597	Kuehne + Nagel International AG	704.288	0,18
8.068	Logitech International SA	440.077	0,11
3.609	Lonza Group AG	1.972.261	0,50
135.148	Nestle SA	14.898.633	3,77
96.532	Novartis AG	8.900.990	2,26

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Schweiz (30. Juni 2022: 18,41 %) (Fortsetzung)			
1.088	Partners Group Holding AG	938.122	0,24
2.169	PSP Swiss Property AG	221.998	0,06
34.640	Roche Holding AG	9.706.435	2,46
1.917	Schindler Holding AG	411.856	0,10
737	SFS Group AG	88.948	0,02
7.000	SGS SA	606.440	0,15
180	Siegfried Holding AG	136.283	0,03
14.248	SIG Group AG	360.266	0,09
6.942	Sika AG	1.818.611	0,46
2.462	Sonova Holding AG	600.834	0,15
5.463	Straumann Holding AG	812.405	0,21
1.363	Swatch Group AG/The	364.609	0,09
1.450	Swiss Life Holding AG	776.952	0,20
3.589	Swiss Prime Site AG	285.522	0,07
14.526	Swiss Re AG	1.340.004	0,34
1.322	Swisscom AG	755.500	0,19
566	Tecan Group AG	199.016	0,05
2.892	Temenos AG	210.783	0,05
147.943	UBS Group AG	2.742.695	0,70
1.263	VAT Group AG '144A'	478.773	0,12
7.327	Zurich Insurance Group AG	3.189.609	0,81
	Schweiz insgesamt	68.806.744	17,43
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 20,56 %)			
46.696	3i Group Plc	1.060.273	0,27
99.592	abrdrn plc	253.231	0,06
9.422	Admiral Group Plc	228.592	0,06
16.373	Allfunds Group Plc	91.525	0,02
17.253	Antofagasta Plc	293.733	0,07
19.631	Ashtead Group Plc	1.245.370	0,32
16.494	Associated British Foods Plc	382.679	0,10

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 20,56 %) (Fortsetzung)			
74.875	AstraZeneca Plc	9.838.517	2,49
44.241	Auto Trader Group Plc '144A'	314.686	0,08
129.807	Aviva Plc	597.796	0,15
699.316	Barclays Plc	1.249.913	0,32
48.578	Barratt Developments Plc	234.074	0,06
34.446	Beazley Plc	236.424	0,06
5.854	Bellway Plc	135.615	0,03
5.276	Berkeley Group Holdings Plc	241.191	0,06
8.615	Big Yellow Group Plc (REIT)	107.719	0,03
44.256	British Land Co Plc/The (REIT)	156.159	0,04
11.919	Britvic Plc	118.892	0,03
337.946	BT Group Plc	481.825	0,12
16.240	Bunzl Plc	567.545	0,14
17.444	Burberry Group Plc	430.943	0,11
6.559	Close Brothers Group Plc	67.375	0,02
86.871	Compass Group Plc	2.229.102	0,56
3.993	Computacenter Plc	106.555	0,03
78.460	ConvaTec Group Plc '144A'	187.613	0,05
6.792	Croda International Plc	445.282	0,11
5.459	Dechra Pharmaceuticals Plc	234.480	0,06
5.250	Derwent London Plc (REIT)	125.415	0,03
109.584	Diageo Plc	4.314.923	1,09
5.940	Diploma Plc	206.549	0,05
63.443	Direct Line Insurance Group Plc	100.508	0,03
63.213	Dowlais Group Plc	93.551	0,02
18.919	Drax Group Plc	127.869	0,03
69.431	DS Smith Plc	219.908	0,06
1.596	Games Workshop Group Plc	203.092	0,05
2.975	Genus Plc	75.090	0,02
4.891	Greggs Plc	145.565	0,04
190.883	GSK Plc	3.089.191	0,78

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 20,56 %) (Fortsetzung)			
246.394	Haleon Plc	925.254	0,23
18.305	Halma Plc	485.703	0,12
16.841	Hargreaves Lansdown Plc	160.060	0,04
76.516	Hays Plc	91.126	0,02
7.649	Hikma Pharmaceuticals Plc	168.507	0,04
27.976	Howden Joinery Group Plc	209.425	0,05
942.931	HSBC Holdings Plc	6.831.224	1,73
19.179	IG Group Holdings Plc	151.305	0,04
12.383	IMI Plc	236.651	0,06
17.661	Inchcape Plc	160.012	0,04
6.324	Indivior Plc	134.343	0,03
69.519	Informa Plc	588.136	0,15
8.259	InterContinental Hotels Group Plc	522.980	0,13
14.081	Intermediate Capital Group Plc	226.028	0,06
35.903	International Distributions Services Plc	92.420	0,02
7.613	Intertek Group Plc	378.366	0,10
32.084	Investec Plc	164.804	0,04
175.444	ITV Plc	139.636	0,04
119.221	JD Sports Fashion Plc	202.835	0,05
91.012	Kingfisher Plc	245.732	0,06
37.131	Land Securities Group Plc (REIT)	248.449	0,06
279.545	Legal & General Group Plc	740.438	0,19
3.138.944	Lloyds Banking Group Plc	1.594.440	0,40
17.838	London Stock Exchange Group Plc	1.739.009	0,44
47.342	LondonMetric Property Plc (REIT)	91.247	0,02
64.596	LXI REIT Plc (REIT)	64.811	0,02
114.331	M&G Plc	255.002	0,06
92.615	Marks & Spencer Group Plc	207.970	0,05
24.168	Mondi Plc	337.674	0,09
242.296	NatWest Group Plc	679.893	0,17
6.018	Next Plc	483.881	0,12

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 20,56 %) (Fortsetzung)			
2.402	NMC Health Plc**	–	–
30.344	Ocado Group Plc	200.844	0,05
21.807	OSB Group Plc	121.976	0,03
32.978	Pearson Plc	315.889	0,08
11.869	Pennon Group Plc	98.338	0,03
15.508	Persimmon Plc	185.323	0,05
37.412	Phoenix Group Holdings Plc	231.845	0,06
129.501	Prudential Plc	1.672.810	0,42
35.961	Reckitt Benckiser Group Plc	2.477.444	0,63
92.111	RELX Plc	2.813.301	0,71
119.863	Rentokil Initial Plc	859.010	0,22
39.822	Rightmove Plc	242.789	0,06
23.056	RS GROUP Plc	204.244	0,05
10.638	Safestore Holdings Plc (REIT)	105.246	0,03
47.209	Sage Group Plc/The	508.757	0,13
44.752	Schroders Plc	228.050	0,06
59.633	Segro Plc (REIT)	498.107	0,13
56.701	Serco Group Plc	102.877	0,03
11.655	Severn Trent Plc	348.503	0,09
40.892	Smith & Nephew Plc	604.220	0,15
17.231	Smiths Group Plc	330.103	0,08
6.345	Softcat Plc	104.697	0,03
5.036	Spectris Plc	210.971	0,05
3.683	Spirax-Sarco Engineering Plc	444.845	0,11
52.794	SSE Plc	1.132.599	0,29
37.703	SSP Group Plc	110.190	0,03
26.969	St James's Place Plc	341.768	0,09
111.562	Standard Chartered Plc	887.922	0,23
18.813	Tate & Lyle Plc	159.159	0,04
170.641	Taylor Wimpey Plc	204.316	0,05
10.474	Travis Perkins Plc	99.156	0,03

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,58 %) (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 20,56 %) (Fortsetzung)			
94.811	Tritax Big Box REIT Plc (REIT)	138.104	0,04
20.828	Tui AG Gbp Npv	135.310	0,03
124.138	Unilever Plc	5.927.362	1,50
19.580	UNITE Group Plc/The (REIT)	198.504	0,05
31.394	United Utilities Group Plc	351.786	0,09
61.406	Virgin Money UK Plc	107.013	0,03
13.539	Vistry Group Plc	104.207	0,03
1.326.901	Vodafone Group Plc	1.143.752	0,29
11.325	Watches of Switzerland Group Plc '144A'	80.568	0,02
12.913	Weir Group Plc/The	264.234	0,07
6.095	WH Smith Plc	109.947	0,03
9.580	Whitbread Plc	377.999	0,10
18.761	Wise Plc - Class A	143.678	0,04
	Vereinigtes Königreich insgesamt	73.723.894	18,68
	Stammaktien insgesamt	392.803.422	99,51
Vorzugsaktien (30. Juni 2022: 0,23 %)			
Deutschland (30. Juni 2022: 0,23 %)			
5.418	Dr Ing hc F Porsche AG - Preference '144A'	616.297	0,16
8.261	Henkel AG & Co KGaA - Preference	605.201	0,15
1.149	Sartorius AG - Preference	364.348	0,09
	Deutschland insgesamt	1.585.846	0,40
	Vorzugsaktien Insgesamt	1.585.846	0,40
Bezugsrechte (30. Juni 2022: – %)			
Belgien (30. Juni 2022: – %)			
1.788	Aedifica S.A. - Rights 05/07/2023	751	–
	Belgien insgesamt	751	–
	Bezugsrechte insgesamt	751	–

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien	392.803.422	99,51
Vorzugsaktien	1.585.846	0,40
Bezugsrechte	751	–
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	360.549	0,09
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	394.750.568	100,00

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,90
Sonstige Vermögenswerte	0,10
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

**Dieses Wertpapier wird mit null bewertet.

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %)			
Bermuda (30. Juni 2022: 0,10 %)			
12.467	Arch Capital Group Ltd	933.155	0,07
1.343	Everest Group Ltd	459.118	0,03
Bermuda insgesamt		1.392.273	0,10
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 0,05 %)			
2.914	GLOBALFOUNDRIES Inc	188.186	0,01
Cayman-Inseln insgesamt		188.186	0,01
Irland (30. Juni 2022: 2,41 %)			
20.750	Accenture Plc - Class A	6.403.035	0,47
6.794	Aon Plc	2.345.289	0,17
17.984	Eaton Corp Plc	3.616.582	0,27
7.182	Horizon Therapeutics Plc	738.669	0,05
31.395	Johnson Controls International plc	2.139.255	0,16
22.605	Linde Plc	8.614.313	0,64
63.785	Medtronic Plc	5.619.459	0,41
9.006	Seagate Technology Holdings Plc	557.201	0,04
4.674	STERIS Plc	1.051.557	0,08
10.429	Trane Technologies Plc	1.994.651	0,15
3.437	Willis Towers Watson Plc	809.413	0,06
Irland insgesamt		33.889.424	2,50
Jersey (30. Juni 2022: 0,17 %)			
66.963	Amcor Plc	668.291	0,05
12.865	Aptiv Plc	1.313.388	0,10
9.770	Ferguson Plc	1.536.918	0,11
Jersey insgesamt		3.518.597	0,26
Liberia (30. Juni 2022: 0,02 %)			
7.443	Royal Caribbean Cruises Ltd	772.137	0,06
Liberia insgesamt		772.137	0,06

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Luxemburg (30. Juni 2022: 0,03 %)			
4.378	Spotify Technology SA	702.888	0,05
Luxemburg insgesamt		702.888	0,05
Panama (30. Juni 2022: – %)			
30.365	Carnival Corp	571.773	0,04
Panama insgesamt		571.773	0,04
Schweiz (30. Juni 2022: 0,44 %)			
14.116	Chubb Ltd	2.718.177	0,20
6.715	Garmin Ltd	700.307	0,05
14.212	TE Connectivity Ltd	1.991.954	0,15
Schweiz insgesamt		5.410.438	0,40
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 0,12 %)			
17.722	Royalty Pharma Plc - Class A	544.774	0,04
Vereinigtes Königreich insgesamt		544.774	0,04
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %)			
17.075	3M Co	1.709.037	0,13
84.350	Abbott Laboratories	9.195.837	0,68
57.161	AbbVie Inc	7.701.302	0,57
24.901	Activision Blizzard Inc	2.099.154	0,15
14.918	Adobe Inc	7.294.753	0,54
75.161	Advanced Micro Devices Inc	8.561.590	0,63
19.065	Aflac Inc	1.330.737	0,10
13.322	Agilent Technologies Inc	1.601.970	0,12
10.234	Air Products and Chemicals Inc	3.065.390	0,23
12.755	Airbnb Inc	1.634.681	0,12
5.375	Akamai Technologies Inc	483.051	0,04
4.929	Albemarle Corp	1.099.611	0,08
5.157	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	585.268	0,04

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
3.273	Align Technology Inc	1.157.464	0,09
10.851	Alliant Energy Corp	569.460	0,04
9.161	Allstate Corp/The	998.915	0,07
4.179	Alnylam Pharmaceuticals Inc	793.759	0,06
176.719	Alphabet Inc	21.377.697	1,58
202.340	Alphabet Inc - Class A	24.220.098	1,79
296.346	Amazon.com Inc	38.631.665	2,85
19.943	American Express Co	3.474.071	0,26
10.462	American Homes 4 Rent (REIT) - Class A	370.878	0,03
22.254	American International Group Inc	1.280.495	0,09
15.371	American Tower Corp (REIT)	2.981.052	0,22
8.531	American Water Works Co Inc	1.217.800	0,09
3.304	Ameriprise Financial Inc	1.097.457	0,08
7.182	AmerisourceBergen Corp	1.382.032	0,10
10.369	AMETEK Inc	1.678.534	0,12
17.126	Amgen Inc	3.802.315	0,28
26.531	Amphenol Corp - Class A	2.253.808	0,17
23.965	Analog Devices Inc	4.668.622	0,34
2.770	ANSYS Inc	914.848	0,07
12.256	Apollo Global Management Inc	941.383	0,07
746.511	Apple Inc	144.800.739	10,69
39.172	Applied Materials Inc	5.661.921	0,42
25.309	Archer-Daniels-Midland Co	1.912.348	0,14
4.646	Ares Management Corp - Class A	447.642	0,03
12.024	Arista Networks Inc	1.948.609	0,14
6.846	Arthur J Gallagher & Co	1.503.176	0,11
234.161	AT&T Inc	3.734.868	0,28
5.253	Atlassian Corp	881.506	0,06
7.497	Autodesk Inc	1.533.961	0,11
13.402	Automatic Data Processing Inc	2.945.626	0,22
877	AutoZone Inc	2.186.677	0,16

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
4.334	AvalonBay Communities Inc (REIT)	820.296	0,06
33.261	Avantor Inc	683.181	0,05
3.767	Avery Dennison Corp	647.171	0,05
3.139	Axon Enterprise Inc	612.482	0,05
14.256	Ball Corp	829.842	0,06
226.786	Bank of America Corp	6.506.490	0,48
25.769	Bank of New York Mellon Corp/The	1.147.236	0,08
23.067	Baxter International Inc	1.050.933	0,08
12.892	Becton Dickinson & Co	3.403.617	0,25
7.704	Bentley Systems Inc - Class B	417.788	0,03
41.908	Berkshire Hathaway Inc - Class B	14.290.628	1,05
9.623	Best Buy Co Inc	788.605	0,06
4.810	Biogen Inc	1.370.128	0,10
6.431	BioMarin Pharmaceutical Inc	557.439	0,04
7.986	Bio-Techne Corp	651.897	0,05
5.035	BlackRock Inc	3.479.890	0,26
23.980	Blackstone Inc	2.229.421	0,16
18.086	Block Inc	1.203.985	0,09
1.214	Booking Holdings Inc	3.278.201	0,24
4.149	Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A	463.028	0,03
68.911	Boston Scientific Corp	3.727.396	0,27
98.052	Bristol-Myers Squibb Co	6.270.425	0,46
19.361	Broadcom Inc	16.794.312	1,24
3.705	Broadridge Financial Solutions Inc	613.659	0,05
7.628	Brown & Brown Inc	525.112	0,04
13.060	Brown-Forman Corp	872.147	0,06
6.257	Builders FirstSource Inc	850.952	0,06
9.411	Cadence Design Systems Inc	2.207.068	0,16
9.139	Campbell Soup Co	417.744	0,03
11.760	Capital One Financial Corp	1.286.191	0,09
12.532	Cardinal Health Inc	1.185.151	0,09

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
38.084	Carrier Global Corp	1.893.156	0,14
3.341	Cboe Global Markets Inc	461.091	0,03
9.676	CBRE Group Inc - Class A	780.950	0,06
6.289	CDW Corp/DE	1.154.032	0,09
19.199	Centene Corp	1.294.973	0,10
9.413	CF Industries Holdings Inc	653.450	0,05
48.780	Charles Schwab Corp/The	2.764.850	0,20
3.666	Charter Communications Inc	1.346.778	0,10
951	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	2.034.189	0,15
10.691	Church & Dwight Co Inc	1.071.559	0,08
9.463	Cigna Group/The	2.655.318	0,20
5.148	Cincinnati Financial Corp	501.003	0,04
3.872	Cintas Corp	1.924.694	0,14
194.171	Cisco Systems Inc	10.046.408	0,74
59.019	Citigroup Inc	2.717.235	0,20
18.813	Citizens Financial Group Inc	490.643	0,04
5.767	Clorox Co/The	917.184	0,07
10.261	Cloudflare Inc	670.762	0,05
11.929	CME Group Inc	2.210.324	0,16
192.668	Coca-Cola Co/The	11.602.467	0,86
16.846	Cognizant Technology Solutions Corp	1.099.707	0,08
38.088	Colgate-Palmolive Co	2.934.300	0,22
135.384	Comcast Corp	5.625.205	0,41
21.395	Conagra Brands Inc	721.439	0,05
7.466	Constellation Brands Inc - Class A	1.837.607	0,14
14.437	Constellation Energy Corp	1.321.707	0,10
2.591	Cooper Cos Inc/The	993.467	0,07
19.858	Copart Inc	1.811.248	0,13
34.671	Corning Inc	1.214.872	0,09
31.153	Corteva Inc	1.785.067	0,13
13.298	CoStar Group Inc	1.183.522	0,09

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
51.625	Coupang Inc - Class A	898.275	0,07
7.728	CrowdStrike Holdings Inc	1.135.011	0,08
14.195	Crown Castle Inc (REIT)	1.617.378	0,12
93.456	CSX Corp	3.186.850	0,24
6.444	Cummins Inc	1.579.811	0,12
41.040	CVS Health Corp	2.837.095	0,21
31.110	Danaher Corp	7.466.400	0,55
3.833	Darden Restaurants Inc	640.418	0,05
8.614	Datadog Inc	847.445	0,06
1.196	Deckers Outdoor Corp	631.081	0,05
12.057	Deere & Co	4.885.376	0,36
17.850	Dexcom Inc	2.293.903	0,17
9.780	Digital Realty Trust Inc (REIT)	1.113.649	0,08
7.694	Discover Financial Services	899.044	0,07
10.845	Dollar General Corp	1.841.264	0,14
10.618	Dollar Tree Inc	1.523.683	0,11
8.162	DoorDash Inc	623.740	0,05
6.395	Dover Corp	944.222	0,07
13.695	DR Horton Inc	1.666.545	0,12
20.212	DuPont de Nemours Inc	1.443.945	0,11
7.776	Dynatrace Inc	400.231	0,03
16.706	eBay Inc	746.591	0,05
16.786	Edison International	1.165.788	0,09
29.592	Edwards Lifesciences Corp	2.791.413	0,21
8.438	Electronic Arts Inc	1.094.409	0,08
7.874	Elevance Health Inc	3.498.339	0,26
37.369	Eli Lilly & Co	17.525.314	1,29
6.390	Enphase Energy Inc	1.070.197	0,08
6.933	Entegris Inc	768.315	0,06
9.049	Entergy Corp	881.101	0,06
2.303	EPAM Systems Inc	517.599	0,04

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
4.021	Equifax Inc	946.141	0,07
3.122	Equinix Inc (REIT)	2.447.461	0,18
5.949	Equity LifeStyle Properties Inc (REIT)	397.929	0,03
11.039	Equity Residential (REIT)	728.243	0,05
1.957	Essex Property Trust Inc (REIT)	458.525	0,03
10.998	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	2.159.787	0,16
5.378	Exact Sciences Corp	504.994	0,04
44.665	Exelon Corp	1.819.652	0,13
5.120	Expedia Group Inc	560.077	0,04
6.772	Expeditors International of Washington Inc	820.292	0,06
4.540	Extra Space Storage Inc (REIT)	675.779	0,05
1.199	FactSet Research Systems Inc	480.379	0,04
791	Fair Isaac Corp	640.085	0,05
25.574	Fastenal Co	1.508.610	0,11
10.727	FedEx Corp	2.659.223	0,20
20.256	Fidelity National Information Services Inc	1.108.003	0,08
20.014	Fifth Third Bancorp	524.567	0,04
344	First Citizens BancShares Inc/NC	441.507	0,03
5.178	First Solar Inc	984.286	0,07
24.453	FirstEnergy Corp	950.733	0,07
20.304	Fiserv Inc	2.561.350	0,19
2.357	FleetCor Technologies Inc	591.796	0,04
5.967	FMC Corp	622.597	0,05
163.417	Ford Motor Co	2.472.499	0,18
21.156	Fortinet Inc	1.599.182	0,12
15.926	Fortive Corp	1.190.787	0,09
3.931	Fox Corp	125.360	0,01
9.424	Fox Corp	320.416	0,02
7.649	Franklin Resources Inc	204.305	0,01
62.927	Freeport-McMoRan Inc	2.517.080	0,19
8.140	Gaming and Leisure Properties Inc (REIT)	394.464	0,03

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
2.495	Gartner Inc	874.023	0,06
17.788	GE HealthCare Technologies Inc	1.445.097	0,11
28.318	General Mills Inc	2.171.991	0,16
59.649	General Motors Co	2.300.065	0,17
6.683	Genuine Parts Co	1.130.964	0,08
40.683	Gilead Sciences Inc	3.135.439	0,23
9.434	Global Payments Inc	929.438	0,07
10.408	Goldman Sachs Group Inc/The	3.356.996	0,25
6.998	Graco Inc	604.277	0,04
11.003	Hartford Financial Services Group Inc/The	792.436	0,06
6.702	HCA Healthcare Inc	2.033.923	0,15
1.663	HEICO Corp	294.251	0,02
3.583	HEICO Corp - Class A	503.770	0,04
7.029	Hershey Co/The	1.755.141	0,13
61.500	Hewlett Packard Enterprise Co	1.033.200	0,08
8.965	Hilton Worldwide Holdings Inc	1.304.856	0,10
11.283	Hologic Inc	913.585	0,07
32.433	Home Depot Inc/The	10.074.987	0,74
13.966	Hormel Foods Corp	561.713	0,04
22.635	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	380.947	0,03
16.924	Howmet Aerospace Inc	838.753	0,06
40.908	HP Inc	1.256.285	0,09
2.457	Hubbell Inc - Class B	814.643	0,06
1.515	HubSpot Inc	806.116	0,06
4.174	Humana Inc	1.866.321	0,14
52.205	Huntington Bancshares Inc/OH	562.770	0,04
3.397	IDEX Corp	731.238	0,05
4.160	IDEXX Laboratories Inc	2.089.277	0,15
13.720	Illinois Tool Works Inc	3.432.195	0,25
7.216	Illumina Inc	1.352.928	0,10
6.409	Incyte Corp	398.960	0,03

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
18.289	Ingersoll Rand Inc	1.195.369	0,09
3.176	Insulet Corp	915.768	0,07
191.518	Intel Corp	6.404.362	0,47
17.851	Intercontinental Exchange Inc	2.018.591	0,15
29.610	International Business Machines Corp	3.962.114	0,29
12.394	International Flavors & Fragrances Inc	986.438	0,07
12.646	Interpublic Group of Cos Inc/The	487.883	0,04
9.432	Intuit Inc	4.321.648	0,32
16.584	Intuitive Surgical Inc	5.670.733	0,42
20.115	Invitation Homes Inc (REIT)	691.956	0,05
8.757	IQVIA Holdings Inc	1.968.311	0,15
9.396	Iron Mountain Inc (REIT)	533.881	0,04
4.471	J M Smucker Co/The	660.233	0,05
5.875	Jabil Inc	634.089	0,05
2.721	JB Hunt Transport Services Inc	492.583	0,04
119.509	Johnson & Johnson	19.781.130	1,46
95.537	JPMorgan Chase & Co	13.894.901	1,03
10.930	Kellogg Co	736.682	0,05
38.709	Keurig Dr Pepper Inc	1.210.430	0,09
8.173	Keysight Technologies Inc	1.368.569	0,10
15.459	Kimberly-Clark Corp	2.134.270	0,16
18.993	KKR & Co Inc	1.063.608	0,08
6.440	KLA Corp	3.123.529	0,23
35.900	Kraft Heinz Co/The	1.274.450	0,09
2.983	Laboratory Corp of America Holdings	719.887	0,05
6.487	Lam Research Corp	4.170.233	0,31
6.511	Lamb Weston Holdings Inc	748.439	0,06
11.182	Las Vegas Sands Corp	648.556	0,05
10.643	Lennar Corp	1.333.674	0,10
1.374	Lennar Corp	155.235	0,01
512	Liberty Media Corp-Liberty Braves	20.285	0,00

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
6.866	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	516.872	0,04
2.668	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	87.537	0,01
5.761	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	188.558	0,01
4.780	Live Nation Entertainment Inc	435.506	0,03
12.030	LKQ Corp	700.988	0,05
19.617	Lowe's Cos Inc	4.427.557	0,33
2.695	LPL Financial Holdings Inc	585.974	0,04
29.964	Lucid Group Inc	206.452	0,02
5.093	Lululemon Athletica Inc	1.927.700	0,14
5.091	M&T Bank Corp	630.062	0,05
437	Markel Group Inc	604.450	0,04
8.786	Marriott International Inc/MD	1.613.900	0,12
16.343	Marsh & McLennan Cos Inc	3.073.791	0,23
2.829	Martin Marietta Materials Inc	1.306.121	0,10
41.347	Marvell Technology Inc	2.471.724	0,18
28.608	Mastercard Inc	11.251.526	0,83
11.395	McCormick & Co Inc/MD	993.986	0,07
24.522	McDonald's Corp	7.317.610	0,54
6.723	McKesson Corp	2.872.805	0,21
1.545	MercadoLibre Inc	1.830.207	0,13
120.378	Merck & Co Inc	13.890.417	1,02
76.726	Meta Platforms Inc - Class A	22.018.827	1,62
20.084	MetLife Inc	1.135.349	0,08
1.104	Mettler-Toledo International Inc	1.448.051	0,11
10.575	MGM Resorts International	464.454	0,03
24.356	Microchip Technology Inc	2.182.054	0,16
54.995	Micron Technology Inc	3.470.734	0,26
251.612	Microsoft Corp	85.683.950	6,32
3.700	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	561.882	0,04
11.346	Moderna Inc	1.378.539	0,10
1.955	Molina Healthcare Inc	588.924	0,04

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
8.259	Molson Coors Beverage Co - Class B	543.773	0,04
64.799	Mondelez International Inc	4.726.439	0,35
1.833	MongoDB Inc - Class A	753.345	0,06
2.094	Monolithic Power Systems Inc	1.131.242	0,08
37.469	Monster Beverage Corp	2.152.219	0,16
5.125	Moody's Corp	1.782.065	0,13
40.775	Morgan Stanley	3.482.185	0,26
8.130	Motorola Solutions Inc	2.384.366	0,18
2.502	MSCI Inc - Class A	1.174.164	0,09
10.516	Nasdaq Inc	524.223	0,04
9.924	NetApp Inc	758.194	0,06
14.648	Netflix Inc	6.452.298	0,48
38.236	Newmont Corp	1.631.148	0,12
92.203	NextEra Energy Inc	6.841.463	0,50
57.427	NIKE Inc	6.338.218	0,47
2.176	Nordson Corp	540.040	0,04
10.420	Norfolk Southern Corp	2.362.839	0,17
7.064	Northern Trust Corp	523.725	0,04
120.179	NVIDIA Corp	50.838.121	3,75
132	NVR Inc	838.282	0,06
5.489	Okta Inc	380.662	0,03
3.182	Old Dominion Freight Line Inc	1.176.544	0,09
6.684	Omnicom Group Inc	635.983	0,05
20.296	ON Semiconductor Corp	1.919.596	0,14
50.824	Oracle Corp	6.052.630	0,45
2.844	O'Reilly Automotive Inc	2.716.873	0,20
19.129	Otis Worldwide Corp	1.702.672	0,13
23.384	PACCAR Inc	1.956.072	0,14
56.213	Palantir Technologies Inc	861.745	0,06
9.823	Palo Alto Networks Inc	2.509.875	0,19
5.438	Parker-Hannifin Corp	2.121.038	0,16

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
10.314	Paychex Inc	1.153.827	0,09
1.599	Paycom Software Inc	513.663	0,04
36.552	PayPal Holdings Inc	2.439.115	0,18
1.749	Penumbra Inc	601.761	0,04
65.333	PepsiCo Inc	12.100.978	0,89
258.374	Pfizer Inc	9.477.158	0,70
18.892	Pinterest Inc	516.507	0,04
12.076	PNC Financial Services Group Inc/The	1.520.972	0,11
1.805	Pool Corp	676.225	0,05
11.179	PPG Industries Inc	1.657.846	0,12
6.749	Principal Financial Group Inc	511.844	0,04
110.072	Procter & Gamble Co/The	16.702.325	1,23
18.977	Progressive Corp/The	2.511.985	0,19
30.401	Prologis Inc (REIT)	3.728.075	0,27
10.817	Prudential Financial Inc	954.276	0,07
3.359	PTC Inc	477.986	0,04
5.229	Public Storage (REIT)	1.526.241	0,11
9.966	PulteGroup Inc	774.159	0,06
52.714	QUALCOMM Inc	6.275.075	0,46
6.435	Quanta Services Inc	1.264.156	0,09
3.755	Quest Diagnostics Inc	527.803	0,04
6.615	Raymond James Financial Inc	686.439	0,05
21.653	Realty Income Corp (REIT)	1.294.633	0,10
3.575	Regeneron Pharmaceuticals Inc	2.568.780	0,19
34.248	Regions Financial Corp	610.299	0,04
2.669	Reliance Steel & Aluminum Co	724.874	0,05
9.258	Republic Services Inc - Class A	1.418.048	0,10
6.836	ResMed Inc	1.493.666	0,11
5.730	Revvity Inc	680.667	0,05
28.152	Rivian Automotive Inc	469.012	0,03
15.461	ROBLOX Corp	623.078	0,05

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
5.097	Rockwell Automation Inc	1.679.207	0,12
10.043	Rollins Inc	430.142	0,03
3.354	Roper Technologies Inc	1.612.603	0,12
16.567	Ross Stores Inc	1.857.658	0,14
10.763	S&P Global Inc	4.314.779	0,32
34.130	Salesforce Inc	7.210.304	0,53
3.612	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	837.117	0,06
4.587	Seagen Inc	882.814	0,07
6.928	ServiceNow Inc	3.893.328	0,29
10.895	Sherwin-Williams Co/The	2.892.840	0,21
10.306	Simon Property Group Inc (REIT)	1.190.137	0,09
19.211	Sirius XM Holdings Inc	87.026	0,01
7.157	Skyworks Solutions Inc	792.208	0,06
2.380	Snap-on Inc	685.892	0,05
8.962	Snowflake Inc	1.577.133	0,12
2.706	SolarEdge Technologies Inc	728.049	0,05
27.011	Southwest Airlines Co	978.068	0,07
5.511	Splunk Inc	584.662	0,04
7.039	SS&C Technologies Holdings Inc	426.563	0,03
37.667	Starbucks Corp	3.731.293	0,28
10.579	State Street Corp	774.171	0,06
6.978	Steel Dynamics Inc	760.114	0,06
16.294	Stryker Corp	4.971.136	0,37
4.148	Sun Communities Inc (REIT)	541.148	0,04
2.001	Super Micro Computer Inc	498.749	0,04
15.620	Synchrony Financial	529.830	0,04
5.331	Synopsys Inc	2.321.171	0,17
23.193	Sysco Corp	1.720.921	0,13
6.979	T Rowe Price Group Inc	781.788	0,06
5.128	Take-Two Interactive Software Inc	754.636	0,06
21.459	Target Corp	2.830.442	0,21

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
2.117	Teledyne Technologies Inc	870.320	0,06
6.889	Teradyne Inc	766.952	0,06
112.873	Tesla Inc	29.546.765	2,18
44.098	Texas Instruments Inc	7.938.522	0,59
18.686	Thermo Fisher Scientific Inc	9.749.420	0,72
54.056	TJX Cos Inc/The	4.583.408	0,34
21.179	T-Mobile US Inc	2.941.763	0,22
5.028	Tractor Supply Co	1.111.691	0,08
14.261	Trade Desk Inc/The - Class A	1.101.234	0,08
2.377	TransDigm Group Inc	2.125.442	0,16
6.409	TransUnion	502.017	0,04
7.988	Travelers Cos Inc/The	1.387.196	0,10
41.025	Truist Financial Corp	1.245.109	0,09
6.231	Twilio Inc - Class A	396.416	0,03
1.334	Tyler Technologies Inc	555.571	0,04
13.494	Tyson Foods Inc - Class A	688.734	0,05
60.891	Uber Technologies Inc	2.628.664	0,19
9.738	UDR Inc (REIT)	418.344	0,03
2.333	Ulta Beauty Inc	1.097.898	0,08
28.081	Union Pacific Corp	5.745.934	0,42
14.778	United Airlines Holdings Inc	810.869	0,06
33.231	United Parcel Service Inc - Class B	5.956.657	0,44
2.833	United Rentals Inc	1.261.733	0,09
31.368	UnitedHealth Group Inc	15.076.716	1,11
46.404	US Bancorp	1.533.188	0,11
5.093	Veeva Systems Inc - Class A	1.007.039	0,07
13.088	Ventas Inc (REIT)	618.670	0,05
3.047	VeriSign Inc	688.531	0,05
4.954	Verisk Analytics Inc - Class A	1.119.753	0,08
141.670	Verizon Communications Inc	5.268.707	0,39
8.377	Vertex Pharmaceuticals Inc	2.947.950	0,22

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
32.258	VICI Properties Inc (REIT) - Class A	1.013.869	0,07
55.340	Visa Inc - Class A	13.142.143	0,97
7.321	VMware Inc	1.051.954	0,08
6.151	Vulcan Materials Co	1.386.681	0,10
6.935	W R Berkley Corp	413.049	0,03
34.572	Walgreens Boots Alliance Inc	984.956	0,07
63.889	Walmart Inc	10.042.073	0,74
58.444	Walt Disney Co/The	5.217.880	0,38
59.496	Warner Bros Discovery Inc	746.080	0,05
18.560	Waste Management Inc	3.218.675	0,24
2.723	Waters Corp	725.788	0,05
1.464	Watsco Inc	558.472	0,04
119.493	Wells Fargo & Co	5.099.961	0,38
15.331	Welltower Inc (REIT)	1.240.125	0,09
3.385	West Pharmaceutical Services Inc	1.294.661	0,10
14.591	Western Digital Corp	553.437	0,04
8.197	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	898.965	0,07
1.465	Westlake Corp	175.024	0,01
23.902	Weyerhaeuser Co (REIT)	800.956	0,06
7.214	Workday Inc - Class A	1.629.570	0,12
9.468	WP Carey Inc (REIT)	639.658	0,05
1.988	WW Grainger Inc	1.567.717	0,12
10.307	Xylem Inc/NY	1.160.774	0,09
12.696	Yum China Holdings Inc	717.324	0,05
9.146	Yum! Brands Inc	1.267.178	0,09
2.394	Zebra Technologies Corp	708.217	0,05
9.525	Zimmer Biomet Holdings Inc	1.386.840	0,10
22.259	Zoetis Inc	3.833.222	0,28

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,89 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 96,55 %) (Fortsetzung)			
7.337	Zoom Video Communications Inc - Class A	498.036	0,04
3.161	Zscaler Inc	462.454	0,03
Vereinigte Staaten insgesamt		1.306.821.292	96,44
Stammaktien insgesamt		1.353.811.782	99,90
Gesamtanlagen			
Stammaktien		1.353.811.782	99,90
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.329.754	0,10
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		1.355.141.536	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,89
Sonstige Vermögenswerte			0,11
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

*Mit Wirkung vom 4. November 2022 wurde der Name des Fonds von L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF in L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF geändert.

L&G Clean Energy UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien 30. Juni 2022: 96,05 %)			
Australien (30. Juni 2022: 3,45 %)			
523.263	Worley Ltd	5.499.924	2,58
Australien insgesamt		5.499.924	2,58
Österreich (30. Juni 2022: 1,75 %)			
86.833	ANDRITZ AG	4.836.241	2,27
Österreich insgesamt		4.836.241	2,27
Britische Jungferninseln (30. Juni 2022: 1,48 %)			
1.136.409	Emeren Group Ltd ADR	4.306.990	2,02
Britische Jungferninseln insgesamt		4.306.990	2,02
Kanada (30. Juni 2022: 8,25 %)			
199.372	Boralex Inc	5.434.655	2,55
129.396	Canadian Solar Inc	5.006.331	2,34
222.646	Northland Power Inc	4.648.978	2,18
Kanada insgesamt		15.089.964	7,07
Dänemark (30. Juni 2022: 2,82 %)			
62.267	Orsted AS '144A'	5.882.860	2,75
186.022	Vestas Wind Systems A/S	4.945.962	2,32
Dänemark insgesamt		10.828.822	5,07
Finland (30 June 2022: 1.35%)			
160.056	Valmet Oyj	4.449.372	2,09
Total Finland		4.449.372	2,09
France (30 June 2022: 4.95%)			
367.750	Engie SA	6.109.743	2,86
224.825	Neoen SA '144A'	7.113.281	3,34
53.688	Nexans SA	4.647.844	2,18

L&G Clean Energy UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien 30. Juni 2022: 96,05 % (Fortsetzung)			
France (30 June 2022: 4.95%) (continued)			
32.914	Schneider Electric SE	5.977.477	2,80
Frankreich insgesamt		23.848.345	11,18
Deutschland (30. Juni 2022: 7,43 %)			
351.811	Nordex SE	4.270.088	2,00
256.102	Siemens Energy AG	4.520.837	2,12
71.899	SMA Solar Technology AG	8.777.692	4,11
Deutschland insgesamt		17.568.617	8,23
Italien (30. Juni 2022: 1,91 %)			
185.778	ERG SpA	5.468.442	2,56
Italien insgesamt		5.468.442	2,56
Japan (30. Juni 2022: 12,11 %)			
783.663	Hitachi Zosen Corp	5.145.440	2,41
394.600	Marubeni Corp	6.661.527	3,12
150.315	Mitsubishi Corp	7.207.132	3,38
431.672	Sumitomo Electric Industries Ltd	5.247.501	2,46
230.104	West Holdings Corp	3.970.521	1,86
Japan insgesamt		28.232.121	13,23
Mauritius (30. Juni 2022: 1,19 %)			
748.308	Azure Power Global Ltd	1.324.505	0,62
Mauritius insgesamt		1.324.505	0,62
Niederlande (30. Juni 2022: 4,19 %)			
68.147	Alfen N.V. '144A'	4.578.401	2,14
423.707	Fugro NV	6.591.929	3,09
Niederlande insgesamt		11.170.330	5,23

L&G Clean Energy UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien 30. Juni 2022: 96,05 % (Fortsetzung)			
Norwegen (30. Juni 2022: 2,60 %)			
740.757	Scatec ASA '144A'	4.860.677	2,28
Norwegen insgesamt		4.860.677	2,28
Spanien (30. Juni 2022: 8,79 %)			
28.805	Acciona SA	4.883.670	2,29
245.637	EDP Renovaveis SA	4.902.906	2,30
187.162	Energia Innovacion y Desarrollo Fotovoltaico SA*	947.407	0,44
94.789	Greenergy Renovables SA	2.916.315	1,36
475.980	Iberdrola SA	6.205.603	2,91
5.413.415	Obrascon Huarte Lain SA	2.755.773	1,29
290.968	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	4.458.557	2,09
445.942	Soltec Power Holdings SA	2.046.327	0,96
Spanien insgesamt		29.116.558	13,64
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 18,90 %)			
118.226	Ameresco Inc - Class A	5.749.330	2,69
263.143	Array Technologies Inc	5.947.032	2,79
653.753	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	3.857.143	1,81
24.878	Enphase Energy Inc	4.166.567	1,95
25.724	First Solar Inc	4.889.875	2,29
73.173	NextEra Energy Inc	5.429.437	2,54
61.938	Ormat Technologies Inc	4.983.532	2,34
16.529	SolarEdge Technologies Inc	4.447.127	2,08
27.315	Tesla Inc	7.150.248	3,35
Vereinigte Staaten insgesamt		46.620.291	21,84
Stammaktien insgesamt		213.221.199	99,91

L&G Clean Energy UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	213.221.199	99,91
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	201.429	0,09
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	213.422.628	100,00

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,42
Nicht zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	0,44
Sonstige Vermögenswerte	0,14
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

*Der Handel dieses Wertpapiers wurde ausgesetzt.

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 99,08 %)					
Australien (30. Juni 2022: 1,39 %)					
500.000	APA Infrastructure Ltd 'EMTN'	4,25 %	26.11.2024	483.032	0,51
400.000	Macquarie Bank Ltd 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	351.483	0,37
200.000	Toyota Finance Australia Ltd 'EMTN'	3,92 %	28.06.2027	183.820	0,19
300.000	Westfield America Management Ltd	2,13 %	30.03.2025	272.029	0,29
Australien insgesamt				1.290.364	1,36
Belgien (30. Juni 2022: 1,17 %)					
500.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	9,75 %	30.07.2024	517.612	0,55
550.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	4,00 %	24.09.2025	524.658	0,55
600.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN	1,25 %	21.09.2027	503.622	0,53
Belgien insgesamt				1.545.892	1,63
Kanada (30. Juni 2022: 4,06 %)					
430.000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,50 %	18.12.2024	400.976	0,42
350.000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	295.406	0,31
250.000	Bank of Nova Scotia/The 'EMTN'	1,25 %	17.12.2025	220.001	0,23
600.000	Bank of Nova Scotia/The 'EMTN'	2,88 %	03.05.2027	524.575	0,55
400.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	1,38 %	09.12.2024	372.032	0,39
400.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	350.741	0,37
230.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	195.023	0,21
400.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	3,63 %	14.06.2027	358.142	0,38
611.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	5,00 %	24.01.2028	574.056	0,60
820.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN'	2,88 %	05.04.2027	716.835	0,76
404.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN'	5,29 %	11.01.2028	382.862	0,40
Kanada insgesamt				4.390.649	4,62
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 0,57 %)					
750.000	Southern Water Services Finance Ltd	6,64 %	31.03.2026	742.230	0,78
Cayman-Inseln insgesamt				742.230	0,78

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 99,08 %) (Fortsetzung)					
Dänemark (30. Juni 2022: 0,55 %)					
645.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN	4,63 %	13.04.2027	608.381	0,64
500.000	Orsted AS 'EMTN'	2,13 %	17.05.2027	432.952	0,46
Dänemark insgesamt				1.041.333	1,10
Finnland (30. Juni 2022: 1,23 %)					
500.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN'	3,38 %	14.01.2026	462.499	0,49
600.000	OP Corporate Bank plc 'GMTN'	1,38 %	04.09.2026	505.042	0,53
Finnland insgesamt				967.541	1,02
Frankreich (30. Juni 2022: 8,71 %)					
700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA	1,25 %	05.12.2025	615.093	0,65
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	2,25 %	18.12.2023	491.227	0,52
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,75 %	19.12.2024	466.991	0,49
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	4,88 %	25.09.2025	479.549	0,50
600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	5,00 %	19.01.2026	575.432	0,60
1.400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,00 %	16.07.2026	1.190.196	1,25
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	5,38 %	25.05.2028	381.245	0,40
500.000	BNP Paribas SA	1,88 %	14.12.2027	408.183	0,43
900.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	3,38 %	23.01.2026	828.007	0,87
400.000	BPCE SA 'EMTN'	1,00 %	22.12.2025	349.253	0,37
200.000	BPCE SA 'EMTN'	1,38 %	23.12.2026	168.678	0,18
400.000	BPCE SA 'EMTN'	6,13 %	24.05.2029	383.015	0,40
700.000	Credit Agricole SA FRN	5,75 %	29.11.2027	673.215	0,71
300.000	Credit Agricole SA 'GMTN'	7,38 %	18.12.2023	300.324	0,32
1.200.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,13 %	11.02.2027	1.028.023	1,08
300.000	Vinci SA 'EMTN'	2,25 %	15.03.2027	263.366	0,28
Frankreich insgesamt				8.601.797	9,05
Deutschland (30. Juni 2022: 1,27 %)					
400.000	Deutsche Bank AG 'EMTN'	3,88 %	12.02.2024	391.321	0,41

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert £	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 99,08 %) (Fortsetzung)					
Deutschland (30. Juni 2022: 1,27 %) (Fortsetzung)					
1.200.000	Deutsche Bank AG 'EMTN'	2,63 %	16.12.2024	1.117.056	1,18
Deutschland insgesamt				1.508.377	1,59
Jersey (30. Juni 2022: 5,18 %)					
300.000	AA Bond Co Ltd	5,50 %	31.07.2027	261.898	0,28
580.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN'	6,27 %	31.07.2025	555.604	0,58
500.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN'	8,45 %	31.01.2028	485.862	0,51
400.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	6,13 %	02.03.2026	394.384	0,42
630.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	7,13 %	14.02.2024	630.657	0,66
845.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	6,75 %	03.12.2026	843.804	0,89
Jersey insgesamt				3.172.209	3,34
Luxemburg (30. Juni 2022: 0,68 %)					
400.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN'	2,00 %	20.10.2025	340.215	0,36
200.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN'	2,25 %	30.11.2023	197.400	0,20
Luxemburg insgesamt				537.615	0,56
Mexiko (30. Juni 2022: 0,31 %)					
500.000	America Movil SAB de CV	5,00 %	27.10.2026	478.503	0,50
Mexiko insgesamt				478.503	0,50
Niederlande (30. Juni 2022: 4,41 %)					
400.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	5,25 %	26.05.2026	387.248	0,41
700.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	5,13 %	22.02.2028	655.133	0,69
300.000	Cooperatieve Rabobank UA 'EMTN'	5,25 %	14.09.2027	278.757	0,29
400.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN'	1,25 %	14.01.2025	369.994	0,39
900.000	ING Groep NV 'EMTN'	3,00 %	18.02.2026	818.348	0,86
300.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN	5,00 %	30.08.2026	287.429	0,30
200.000	Koninklijke KPN NV 'GMTN'	5,00 %	18.11.2026	191.441	0,20
700.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	1,00 %	20.02.2025	646.856	0,68
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	2,75 %	10.09.2025	280.354	0,30

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 99,08 %) (Fortsetzung)					
Niederlande (30. Juni 2022: 4,41 %) (Fortsetzung)					
200.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV 'EMTN'	0,75 %	19.12.2025	175.390	0,19
262.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV 'EMTN'	4,63 %	08.06.2026	250.259	0,26
300.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN'	5,50 %	07.12.2026	286.985	0,30
400.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN'	3,25 %	13.04.2027	351.771	0,37
400.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN'	2,13 %	18.01.2028	329.326	0,35
Niederlande insgesamt				5.309.291	5,59
Norwegen (30. Juni 2022: 1,91 %)					
260.000	DNB Bank ASA 'EMTN'	1,63 %	15.12.2023	254.925	0,27
947.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN	4,00 %	17.08.2027	866.895	0,91
1.546.000	DNB Bank ASA FRN	2,63 %	10.06.2026	1.429.584	1,50
Norwegen insgesamt				2.551.404	2,68
Spanien (30. Juni 2022: 6,21 %)					
1.100.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,38 %	31.07.2024	1.042.300	1,10
900.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,50 %	14.04.2026	774.264	0,81
700.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,75 %	17.02.2027	580.647	0,61
800.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN	3,13 %	06.10.2026	724.965	0,76
800.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN	1,50 %	03.12.2026	691.438	0,73
600.000	Telefonica Emisiones SA 'EMTN'	5,38 %	02.02.2026	582.134	0,61
Spanien insgesamt				4.395.748	4,62
Schweden (30. Juni 2022: – %)					
400.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN'	1,63 %	15.12.2023	392.251	0,41
400.000	Swedbank AB FRN	1,38 %	08.12.2027	332.204	0,35
319.000	Swedbank AB 'GMTN' FRN	5,88 %	24.05.2029	303.361	0,32
Schweden insgesamt				1.027.816	1,08
Schweiz (30. Juni 2022: 2,19 %)					
517.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	449.068	0,47
250.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN'	7,75 %	10.03.2026	253.164	0,27

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 99,08 %) (Fortsetzung)					
Schweiz (30. Juni 2022: 2,19 %) (Fortsetzung)					
460.000	UBS Group AG	2,75 %	08.08.2025	417.238	0,44
390.000	UBS Group AG FRN	2,13 %	12.09.2025	365.360	0,38
300.000	UBS AG/London 'EMTN'	0,63 %	18.12.2023	292.715	0,31
439.000	UBS Group AG FRN	7,00 %	30.09.2027	432.831	0,46
Schweiz insgesamt				2.210.376	2,33
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 39,62 %)					
400.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	2,65 %	12.07.2025	363.207	0,38
960.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,13 %	17.01.2024	942.655	0,99
500.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,00 %	08.05.2026	446.834	0,47
1.350.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,25 %	12.02.2027	1.183.994	1,25
500.000	Barclays Plc FRN	1,70 %	03.11.2026	439.498	0,46
500.000	BUPA Finance Plc	2,00 %	05.04.2024	483.491	0,51
500.000	BUPA Finance Plc	5,00 %	08.12.2026	464.039	0,49
400.000	BUPA Finance Plc	1,75 %	14.06.2027	332.939	0,35
366.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,88 %	24.10.2023	361.205	0,38
420.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,00 %	21.09.2025	370.437	0,39
630.000	Diageo Finance Plc 'EMTN'	1,75 %	12.10.2026	554.333	0,58
480.000	Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	5,75 %	08.03.2024	477.889	0,50
350.000	Electricity North West Ltd	8,88 %	25.03.2026	369.213	0,39
330.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	2,13 %	27.09.2024	313.961	0,33
870.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	0,74 %	29.10.2025	766.963	0,81
517.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	6,50 %	20.05.2024	516.806	0,54
300.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	5,75 %	20.12.2027	285.384	0,30
900.000	HSBC Holdings Plc FRN	2,26 %	13.11.2026	803.008	0,84
1.000.000	HSBC Holdings Plc FRN	1,75 %	24.07.2027	852.720	0,90
400.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN'	3,75 %	14.08.2025	374.809	0,39
409.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN'	2,13 %	24.08.2026	353.919	0,37
550.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	1,97 %	08.02.2024	535.392	0,56
600.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,38 %	29.03.2027	520.297	0,55
730.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN'	1,75 %	11.07.2024	696.557	0,73

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 99,08 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 39,62 %) (Fortsetzung)					
510.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN'	7,50 %	15.04.2024	514.135	0,54
850.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN'	2,25 %	16.10.2024	804.620	0,85
100.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' FRN	2,00 %	12.04.2028	83.061	0,09
900.000	Lloyds Banking Group Plc FRN	1,88 %	15.01.2026	833.811	0,88
300.000	London & Quadrant Housing Trust	2,63 %	05.05.2026	270.686	0,28
300.000	London Power Networks Plc 'EMTN'	6,13 %	07.06.2027	295.848	0,31
500.000	Manchester Airport Group Funding Plc 'EMTN'	4,13 %	02.04.2024	491.691	0,52
350.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	3,75 %	16.07.2026	328.581	0,35
426.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	4,38 %	08.02.2027	402.393	0,42
400.000	National Grid Electricity Distribution Plc	3,63 %	06.11.2023	396.556	0,42
500.000	National Grid Electricity Distribution Plc	3,50 %	16.10.2026	454.056	0,48
500.000	National Grid Electricity Distribution West Midlands Plc 'EMTN'	3,88 %	17.10.2024	483.597	0,51
400.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN'	1,38 %	16.09.2026	345.149	0,36
600.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN'	4,00 %	08.06.2027	548.353	0,58
1.600.000	Nationwide Building Society FRN	6,18 %	07.12.2027	1.550.734	1,63
750.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN	2,88 %	19.09.2026	680.550	0,72
500.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN	3,13 %	28.03.2027	448.391	0,47
332.000	NatWest Markets Plc 'EMTN'	6,63 %	22.06.2026	329.036	0,35
562.000	NatWest Markets Plc 'EMTN'	6,38 %	08.11.2027	552.659	0,58
420.000	Northumbrian Water Finance Plc	1,63 %	11.10.2026	358.755	0,38
300.000	Northumbrian Water Finance Plc	2,38 %	05.10.2027	254.387	0,27
425.000	Pension Insurance Corp Plc	6,50 %	03.07.2024	420.376	0,44
610.000	Phoenix Group Holdings Plc	6,63 %	18.12.2025	596.069	0,63
564.000	Rothesay Life Plc	3,38 %	12.07.2026	501.047	0,53
800.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN'	3,63 %	14.01.2026	731.511	0,77
920.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN' FRN	2,92 %	08.05.2026	844.268	0,89
985.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN' FRN	7,10 %	16.11.2027	967.319	1,02
300.000	Severn Trent Utilities Finance Plc	6,13 %	26.02.2024	299.379	0,31
580.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	3,63 %	16.01.2026	540.189	0,57
350.000	Sky Ltd 'EMTN'	6,00 %	21.05.2027	348.594	0,37
200.000	Southern Gas Networks Plc 'EMTN'	4,88 %	05.10.2023	199.282	0,21

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 99,08 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 39,62 %) (Fortsetzung)					
400.000	Southern Gas Networks Plc 'EMTN'	2,50 %	03.02.2025	376.081	0,39
400.000	SP Manweb Plc 'EMTN'	4,88 %	20.09.2027	379.049	0,40
210.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN'	2,50 %	02.05.2025	196.581	0,21
457.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,00 %	19.06.2025	423.185	0,44
450.000	Unilever Plc	1,50 %	22.07.2026	398.494	0,42
370.000	Unilever Plc 'EMTN'	2,13 %	28.02.2028	319.062	0,33
570.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	2,00 %	14.02.2025	532.119	0,56
300.000	United Utilities Water Ltd 'EMTN'	5,63 %	20.12.2027	291.765	0,31
800.000	Virgin Money UK Plc 'EMTN' FRN	4,00 %	25.09.2026	723.467	0,76
500.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN	3,13 %	22.06.2025	474.367	0,50
500.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN	3,38 %	24.04.2026	455.131	0,48
600.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN	4,00 %	03.09.2027	525.268	0,55
680.000	Whitbread Group Plc	3,38 %	16.10.2025	623.452	0,66
400.000	Whitbread Group Plc	2,38 %	31.05.2027	333.017	0,35
500.000	Yorkshire Building Society 'EMTN'	3,50 %	21.04.2026	459.524	0,48
Vereinigtes Königreich insgesamt				35.195.195	37,03
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 18,83 %)					
450.000	American Honda Finance Corp	0,75 %	25.11.2026	376.709	0,40
200.000	American Honda Finance Corp 'EMTN'	1,50 %	19.10.2027	166.836	0,17
610.000	Amgen Inc	5,50 %	07.12.2026	593.976	0,62
1.000.000	AT&T Inc	2,90 %	04.12.2026	890.504	0,94
750.000	AT&T Inc	5,50 %	15.03.2027	721.365	0,76
690.000	Bank of America Corp 'EMTN'	2,30 %	25.07.2025	633.675	0,67
690.000	Citigroup Inc	2,75 %	24.01.2024	677.171	0,71
650.000	Citigroup Inc	1,75 %	23.10.2026	560.060	0,59
284.000	Citigroup Inc 'EMTN'	5,15 %	21.05.2026	274.875	0,29
600.000	Digital Stout Holding LLC 'EMTN'	4,25 %	17.01.2025	576.775	0,61
536.000	Fiserv Inc	2,25 %	01.07.2025	492.098	0,52
300.000	General Motors Financial Co Inc 'EMTN'	2,25 %	06.09.2024	284.577	0,30
200.000	General Motors Financial Co Inc 'EMTN'	2,35 %	03.09.2025	181.733	0,19

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 99,08 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 18,83 %) (Fortsetzung)					
207.000	General Motors Financial Co Inc 'EMTN'	5,15 %	15.08.2026	196.381	0,21
330.000	Goldman Sachs Group Inc/The	7,13 %	07.08.2025	331.847	0,35
900.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	4,25 %	29.01.2026	849.188	0,89
519.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	1,50 %	07.12.2027	420.310	0,44
500.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN	1,00 %	16.12.2025	461.571	0,48
530.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN'	3,50 %	18.12.2026	486.088	0,51
1.110.000	JPMorgan Chase & Co FRN	0,99 %	28.04.2026	1.004.956	1,06
470.000	MetLife Inc	5,38 %	09.12.2024	460.709	0,48
556.000	Metropolitan Life Global Funding I	4,13 %	02.09.2025	528.188	0,56
579.000	Metropolitan Life Global Funding I	0,63 %	08.12.2027	454.289	0,48
783.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	3,50 %	30.09.2026	716.164	0,75
910.000	Morgan Stanley 'GMTN'	2,63 %	09.03.2027	796.261	0,84
477.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	0,63 %	18.12.2025	420.779	0,44
255.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	2,13 %	04.04.2027	223.974	0,24
670.000	New York Life Global Funding	1,63 %	15.12.2023	656.493	0,69
548.000	New York Life Global Funding 'EMTN'	4,35 %	16.09.2025	523.515	0,55
950.000	New York Life Global Funding 'EMTN'	1,50 %	15.07.2027	795.360	0,84
430.000	New York Life Global Funding 'GMTN'	1,25 %	17.12.2026	363.156	0,38
523.000	Realty Income Corp	1,13 %	13.07.2027	419.155	0,44
500.000	Toyota Motor Credit Corp	0,75 %	19.11.2026	418.556	0,44
420.000	Verizon Communications Inc	4,07 %	18.06.2024	412.714	0,43
260.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,13 %	20.12.2023	255.051	0,27
595.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,00 %	28.07.2025	539.986	0,57
411.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' FRN	3,47 %	26.04.2028	360.960	0,38
Vereinigte Staaten insgesamt				18.526.005	19,49
Unternehmensanleihen insgesamt				93.492.345	98,37

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen	93.492.345	98,37
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten*	1.547.290	1,63
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	95.039.635	100,00

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	98,36
Sonstige Vermögenswerte	1,64
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

*In den sonstigen Vermögenswerten sind Anteile am LGIM Sterling Liquidity Fund mit einem Wert von 65.285 £ enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %)					
Australien (30. Juni 2022: 1,44 %)					
170.000	APA Infrastructure Ltd	3,13 %	18.07.2031	133.650	0,13
200.000	APA Infrastructure Ltd 'EMTN'	4,25 %	26.11.2024	193.213	0,18
250.000	APA Infrastructure Ltd 'EMTN'	3,50 %	22.03.2030	207.750	0,19
103.000	Macquarie Bank Ltd 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	90.507	0,08
200.000	Macquarie Group Ltd 'EMTN'	2,13 %	01.10.2031	146.854	0,14
300.000	Westfield America Management Ltd	2,13 %	30.03.2025	272.029	0,26
500.000	Westfield America Management Ltd	2,63 %	30.03.2029	377.131	0,35
Australien insgesamt				1.421.134	1,33
Belgien (30. Juni 2022: 0,89 %)					
200.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	9,75 %	30.07.2024	207.045	0,19
400.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	4,00 %	24.09.2025	381.569	0,36
300.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN	1,25 %	21.09.2027	251.811	0,24
Belgien insgesamt				840.425	0,79
Kanada (30. Juni 2022: 1,25 %)					
600.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	3,63 %	14.06.2027	537.213	0,50
584.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	5,00 %	24.01.2028	548.689	0,51
350.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN'	2,88 %	05.04.2027	305.966	0,29
468.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN'	5,29 %	11.01.2028	443.513	0,42
Kanada insgesamt				1.835.381	1,72
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 0,73 %)					
340.000	Southern Water Services Finance Ltd	6,64 %	31.03.2026	336.478	0,31
300.000	Southern Water Services Finance Ltd 'EMTN'	2,38 %	28.05.2028	245.080	0,23
420.000	Southern Water Services Finance Ltd 'EMTN'	3,00 %	28.05.2037	284.770	0,27
Cayman-Inseln insgesamt				866.328	0,81
Dänemark (30. Juni 2022: 0,86 %)					
300.000	Orsted AS 'EMTN'	2,13 %	17.05.2027	259.772	0,24

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Dänemark (30. Juni 2022: 0,86 %) (Fortsetzung)					
100.000	Orsted AS 'EMTN'	2,50 %	16.05.2033	74.982	0,07
414.000	Orsted AS 'EMTN'	5,13 %	13.09.2034	386.642	0,36
430.000	Orsted AS FRN	2,50 %	18.02.3021	286.388	0,27
Dänemark insgesamt				1.007.784	0,94
Finnland (30. Juni 2022: 0,32 %)					
350.000	OP Corporate Bank plc 'GMTN'	1,38 %	04.09.2026	294.608	0,28
Finnland insgesamt				294.608	0,28
Frankreich (30. Juni 2022: 6,97 %)					
700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA	1,25 %	05.12.2025	615.094	0,58
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	4,88 %	25.09.2025	95.910	0,09
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	5,00 %	19.01.2026	95.906	0,09
700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,00 %	16.07.2026	595.098	0,56
200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	0,88 %	07.12.2027	158.631	0,15
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	5,38 %	25.05.2028	95.311	0,09
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,88 %	26.10.2028	242.162	0,23
400.000	BNP Paribas SA	1,88 %	14.12.2027	326.546	0,31
400.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	3,38 %	23.01.2026	368.003	0,34
200.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	2,88 %	24.02.2029	165.311	0,15
300.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	1,25 %	13.07.2031	206.162	0,19
300.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	5,75 %	13.06.2032	284.788	0,27
100.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	2,00 %	13.09.2036	62.789	0,06
200.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN	2,00 %	24.05.2031	168.143	0,16
400.000	BPCE SA	5,25 %	16.04.2029	356.276	0,33
100.000	BPCE SA 'EMTN'	6,13 %	24.05.2029	95.754	0,09
100.000	BPCE SA FRN	2,50 %	30.11.2032	79.176	0,07
600.000	Credit Agricole SA	4,88 %	23.10.2029	558.998	0,52
500.000	Orange SA 'EMTN'	3,25 %	15.01.2032	420.352	0,39
200.000	Orange SA 'EMTN'	5,63 %	23.01.2034	199.933	0,19

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
50.000	Orange SA 'EMTN'	5,38 %	22.11.2050	48.616	0,05
Frankreich (30. Juni 2022: 6,97 %) (Fortsetzung)					
200.000	Vinci SA 'EMTN'	2,25 %	15.03.2027	175.577	0,16
Frankreich insgesamt				5.414.536	5,07
Deutschland (30. Juni 2022: 0,86 %)					
200.000	Deutsche Bank AG 'EMTN'	3,88 %	12.02.2024	195.660	0,18
300.000	Deutsche Bank AG 'EMTN'	2,63 %	16.12.2024	279.264	0,26
300.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN	6,13 %	12.12.2030	275.725	0,26
Deutschland insgesamt				750.649	0,70
Irland (30. Juni 2022: – %)					
900.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 'EMTN' FRN	5,13 %	23.11.2052	779.512	0,73
Irland insgesamt				779.512	0,73
Italien (30. Juni 2022: – %)					
300.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN'	2,50 %	15.01.2030	233.005	0,22
384.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN'	6,63 %	31.05.2033	368.494	0,35
500.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' FRN	6,50 %	14.03.2029	470.387	0,44
Italien insgesamt				1.071.886	1,01
Jersey (30. Juni 2022: 4,87 %)					
300.000	AA Bond Co Ltd	5,50 %	31.07.2027	261.898	0,24
400.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN'	6,27 %	31.07.2025	383.175	0,36
325.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	6,13 %	02.03.2026	320.437	0,30
150.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	2,50 %	15.04.2030	119.428	0,11
100.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	4,63 %	27.03.2034	87.318	0,08
125.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	5,75 %	23.01.2037	117.582	0,11
300.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	3,13 %	28.09.2039	203.038	0,19
100.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	6,50 %	02.03.2041	101.264	0,09
100.000	Heathrow Funding Ltd	2,63 %	16.03.2028	81.298	0,08
380.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	7,13 %	14.02.2024	380.396	0,36
500.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	6,75 %	03.12.2026	499.293	0,47

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert £	% des Netto-vermögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Jersey (30. Juni 2022: 4,87 %) (Fortsetzung)					
460.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	5,88 %	13.05.2041	443.623	0,42
625.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	4,63 %	31.10.2046	507.011	0,47
350.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	2,75 %	09.08.2049	203.744	0,19
290.000	Heathrow Funding Ltd 'REGS'	6,45 %	10.12.2031	294.408	0,28
Jersey insgesamt				4.003.913	3,75
Luxemburg (30. Juni 2022: 1,28 %)					
600.000	Aroundtown SA 'EMTN'	3,00 %	16.10.2029	379.282	0,36
520.000	Aroundtown SA 'EMTN' FRN (Perpetual)	4,75 %	25.06.2024	187.162	0,18
200.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl	4,88 %	29.04.2032	150.897	0,14
100.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN'	2,00 %	20.10.2025	85.054	0,08
220.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN'	2,63 %	20.10.2028	161.448	0,15
600.000	CK Hutchison Group Telecom Finance SA	2,00 %	17.10.2027	496.107	0,46
200.000	CK Hutchison Group Telecom Finance SA	2,63 %	17.10.2034	131.630	0,12
Luxemburg insgesamt				1.591.580	1,49
Mexiko (30. Juni 2022: 0,83 %)					
100.000	America Movil SAB de CV	5,00 %	27.10.2026	95.700	0,09
236.000	America Movil SAB de CV	5,75 %	28.06.2030	233.241	0,22
300.000	America Movil SAB de CV	4,38 %	07.08.2041	249.200	0,23
300.000	America Movil SAB de CV 'EMTN'	4,95 %	22.07.2033	279.948	0,26
Mexiko insgesamt				858.089	0,80
Niederlande (30. Juni 2022: 3,86 %)					
200.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	5,25 %	26.05.2026	193.624	0,18
300.000	Allianz Finance II BV	4,50 %	13.03.2043	273.501	0,26
500.000	Cooperatieve Rabobank UA 'EMTN'	4,63 %	23.05.2029	439.312	0,41
300.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN	1,88 %	12.07.2028	251.618	0,24
100.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN'	1,25 %	14.01.2025	92.499	0,09
400.000	ING Groep NV 'EMTN'	3,00 %	18.02.2026	363.710	0,34
400.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN	1,13 %	07.12.2028	314.134	0,29

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Niederlande (30. Juni 2022: 3,86 %) (Fortsetzung)					
600.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN	6,25 %	20.05.2033	556.563	0,52
250.000	Koninklijke KPN NV 'GMTN'	5,00 %	18.11.2026	239.301	0,22
500.000	Koninklijke KPN NV 'GMTN'	5,75 %	17.09.2029	479.458	0,45
400.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	1,00 %	20.02.2025	369.632	0,35
200.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	2,75 %	10.09.2025	186.902	0,18
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	3,75 %	10.09.2042	250.656	0,23
200.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV 'EMTN'	4,63 %	08.06.2026	191.038	0,18
200.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN'	3,25 %	13.04.2027	175.885	0,16
300.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN'	2,13 %	18.01.2028	246.994	0,23
200.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN'	5,88 %	23.05.2029	191.462	0,18
Niederlande insgesamt				4.816.289	4,51
Norwegen (30. Juni 2022: 1,10 %)					
400.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN	1,38 %	02.12.2025	371.357	0,35
200.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN	4,00 %	17.08.2027	183.082	0,17
436.000	DNB Bank ASA FRN	2,63 %	10.06.2026	403.169	0,38
420.000	Equinor ASA 'EMTN'	6,88 %	11.03.2031	456.595	0,43
Norwegen insgesamt				1.414.203	1,33
Spanien (30. Juni 2022: 2,96 %)					
300.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,38 %	31.07.2024	284.263	0,27
300.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,50 %	14.04.2026	258.088	0,24
300.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,75 %	17.02.2027	248.849	0,23
400.000	Banco Santander SA 'EMTN'	5,13 %	25.01.2030	373.667	0,35
400.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN	3,13 %	06.10.2026	362.482	0,34
300.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN	4,75 %	30.08.2028	278.029	0,26
400.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN	2,25 %	04.10.2032	316.403	0,30
100.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN	1,50 %	03.12.2026	86.430	0,08
400.000	CaixaBank SA FRN	3,50 %	06.04.2028	348.272	0,33
450.000	Telefonica Emisiones SA 'EMTN'	5,45 %	08.10.2029	429.368	0,40
Spanien insgesamt				2.985.851	2,80

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Schweden (30. Juni 2022: – %)					
350.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN' FRN	4,63 %	23.08.2032	311.079	0,29
634.000	Swedbank AB FRN	7,27 %	15.11.2032	614.984	0,58
160.000	Swedbank AB 'GMTN' FRN	5,88 %	24.05.2029	152.156	0,14
Schweden insgesamt				1.078.219	1,01
Schweiz (30. Juni 2022: 1,06 %)					
211.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	183.275	0,17
250.000	UBS Group AG 'EMTN' FRN	2,25 %	09.06.2028	206.631	0,19
400.000	UBS Group AG FRN	2,13 %	12.09.2025	374.728	0,35
300.000	UBS Group AG FRN	2,13 %	15.11.2029	234.639	0,22
525.000	UBS Group AG FRN	7,00 %	30.09.2027	517.623	0,49
200.000	UBS Group AG FRN	1,88 %	03.11.2029	155.522	0,15
Schweiz insgesamt				1.672.418	1,57
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 49,58 %)					
310.000	3i Group Plc	3,75 %	05.06.2040	221.004	0,21
100.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	2,65 %	12.07.2025	90.802	0,08
341.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	3,18 %	12.07.2029	272.017	0,25
220.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	2,31 %	06.10.2032	153.049	0,14
220.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	3,69 %	12.07.2034	165.602	0,16
200.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	3,94 %	12.07.2047	137.093	0,13
300.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	2,92 %	06.10.2051	163.544	0,15
357.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN	4,38 %	12.09.2049	301.526	0,28
250.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN	5,13 %	04.06.2050	217.492	0,20
150.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN	6,88 %	20.05.2058	165.733	0,16
150.000	Aviva Plc FRN	6,13 %	14.11.2036	144.492	0,14
300.000	Aviva Plc FRN	4,00 %	03.06.2055	224.766	0,21
300.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,13 %	17.01.2024	294.580	0,28
400.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,25 %	12.02.2027	350.813	0,33
300.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,25 %	17.01.2033	224.852	0,21
490.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN	6,37 %	31.01.2031	469.419	0,44

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 49,58 %) (Fortsetzung)					
599.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN	8,41 %	14.11.2032	594.763	0,56
200.000	Barclays Plc FRN	1,70 %	03.11.2026	175.799	0,16
430.000	British Telecommunications Plc	5,75 %	07.12.2028	414.946	0,39
290.000	British Telecommunications Plc 'EMTN'	3,13 %	21.11.2031	233.781	0,22
300.000	British Telecommunications Plc 'EMTN'	6,38 %	23.06.2037	292.832	0,27
100.000	BUPA Finance Plc	2,00 %	05.04.2024	96.698	0,09
160.000	BUPA Finance Plc	1,75 %	14.06.2027	133.175	0,12
400.000	BUPA Finance Plc	4,13 %	14.06.2035	294.062	0,28
700.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	2,13 %	22.09.2028	566.891	0,53
100.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	5,75 %	14.03.2034	96.100	0,09
200.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	2,25 %	10.10.2035	132.750	0,12
350.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	2,63 %	22.09.2038	225.589	0,21
150.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	3,13 %	21.03.2040	101.947	0,10
560.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	2,75 %	22.09.2046	324.740	0,30
300.000	Centrica Plc 'EMTN'	4,38 %	13.03.2029	271.070	0,25
441.000	Centrica Plc 'EMTN'	7,00 %	19.09.2033	470.160	0,44
300.000	Centrica Plc 'EMTN'	4,25 %	12.09.2044	231.157	0,22
200.000	Clarion Funding Plc 'EMTN'	2,63 %	18.01.2029	168.159	0,16
120.000	Clarion Funding Plc 'EMTN'	1,25 %	13.11.2032	81.434	0,08
230.000	Clarion Funding Plc 'EMTN'	1,88 %	22.01.2035	154.784	0,14
336.000	Clarion Funding Plc 'EMTN'	3,13 %	19.04.2048	220.762	0,21
210.064	Connect Plus M25 Issuer Plc	2,61 %	31.03.2039	163.122	0,15
170.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,00 %	21.09.2025	149.939	0,14
300.000	Diageo Finance Plc	2,88 %	27.03.2029	259.498	0,24
135.000	Diageo Finance Plc	2,75 %	08.06.2038	98.279	0,09
100.000	Diageo Finance Plc 'EMTN'	1,75 %	12.10.2026	87.989	0,08
320.000	Diageo Finance Plc 'EMTN'	2,38 %	08.06.2028	274.909	0,26
300.000	Diageo Finance Plc 'EMTN'	1,25 %	28.03.2033	208.565	0,20
200.000	DWR Cymru Financing UK Plc 'EMTN'	2,50 %	31.03.2036	144.133	0,13
150.000	Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	5,75 %	08.03.2024	149.340	0,14
100.000	Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	1,88 %	01.06.2035	67.276	0,06

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 49,58 %) (Fortsetzung)					
300.000	Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	6,25 %	12.11.2036	308.869	0,29
300.000	Electricity North West Ltd	8,88 %	25.03.2026	316.468	0,30
85.714	Eversholt Funding Plc 'EMTN'	6,70 %	22.02.2035	85.417	0,08
278.205	Eversholt Funding Plc 'EMTN'	2,74 %	30.06.2040	214.097	0,20
200.000	Eversholt Funding Plc 'EMTN'	3,53 %	07.08.2042	142.980	0,13
110.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	2,13 %	27.09.2024	104.654	0,10
450.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	0,74 %	29.10.2025	396.705	0,37
410.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	3,25 %	07.04.2032	341.570	0,32
120.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	1,25 %	12.10.2028	96.523	0,09
414.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	5,25 %	19.12.2033	411.750	0,39
350.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	6,38 %	09.03.2039	382.438	0,36
230.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	5,25 %	10.04.2042	223.575	0,21
170.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	4,25 %	18.12.2045	143.320	0,13
230.000	HSBC Bank Plc 'EMTN'	4,75 %	24.03.2046	181.966	0,17
250.000	HSBC Holdings Plc	6,75 %	11.09.2028	243.690	0,23
300.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	6,50 %	20.05.2024	299.887	0,28
200.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	5,75 %	20.12.2027	190.256	0,18
250.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	7,00 %	07.04.2038	242.230	0,23
400.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	6,00 %	29.03.2040	351.019	0,33
450.000	HSBC Holdings Plc FRN	2,26 %	13.11.2026	401.504	0,38
610.000	HSBC Holdings Plc FRN	1,75 %	24.07.2027	520.159	0,49
778.000	HSBC Holdings Plc FRN	3,00 %	22.07.2028	668.273	0,63
300.000	HSBC Holdings Plc FRN	3,00 %	29.05.2030	244.398	0,23
124.000	HSBC Holdings Plc FRN	8,20 %	16.11.2034	125.806	0,12
200.000	Hyde Housing Association Ltd	1,75 %	18.08.2055	92.059	0,09
400.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN'	3,75 %	14.08.2025	374.809	0,35
400.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN'	3,38 %	08.10.2028	339.715	0,32
1.100.000	Investec Plc 'EMTN' FRN	1,88 %	16.07.2028	862.554	0,81
350.000	Investec Plc 'EMTN' FRN	2,63 %	04.01.2032	271.031	0,25
300.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	1,97 %	08.02.2024	292.032	0,27
200.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,40 %	08.02.2029	166.670	0,16

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 49,58 %) (Fortsetzung)					
300.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	4,88 %	15.09.2032	284.553	0,27
280.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,63 %	22.09.2037	196.589	0,18
300.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,75 %	22.09.2059	173.743	0,16
174.000	Legal & General Finance Plc 'EMTN'	5,88 %	11.12.2031	176.325	0,17
240.000	Legal & General Group Plc 'EMTN' FRN	5,50 %	27.06.2064	217.774	0,20
480.000	Legal & General Group Plc FRN	5,13 %	14.11.2048	431.996	0,40
200.000	Legal & General Group Plc FRN	4,50 %	01.11.2050	167.363	0,16
200.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN'	1,75 %	11.07.2024	190.838	0,18
400.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN'	7,50 %	15.04.2024	403.243	0,38
280.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN'	6,50 %	17.09.2040	316.057	0,30
400.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN'	2,25 %	16.10.2024	378.645	0,35
500.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' FRN	2,00 %	12.04.2028	415.305	0,39
503.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' FRN	6,63 %	02.06.2033	477.197	0,45
274.000	Lloyds Banking Group Plc FRN	1,88 %	15.01.2026	253.849	0,24
140.000	Lloyds Banking Group Plc FRN	1,99 %	15.12.2031	115.820	0,11
850.000	Lloyds Banking Group Plc FRN	2,71 %	03.12.2035	616.045	0,58
100.000	London & Quadrant Housing Trust	2,63 %	05.05.2026	90.229	0,08
210.000	London & Quadrant Housing Trust	5,50 %	27.01.2040	202.101	0,19
100.000	London & Quadrant Housing Trust 'EMTN'	2,00 %	31.03.2032	74.097	0,07
300.000	M&G Plc 'EMTN' FRN	5,56 %	20.07.2055	253.837	0,24
350.000	M&G Plc 'EMTN' FRN	6,34 %	19.12.2063	302.450	0,28
560.000	M&G Plc FRN	5,63 %	20.10.2051	495.282	0,46
200.000	M&G Plc FRN	6,25 %	20.10.2068	169.523	0,16
100.000	Manchester Airport Group Funding Plc 'EMTN'	4,13 %	02.04.2024	98.338	0,09
200.000	Manchester Airport Group Funding Plc 'EMTN'	4,75 %	31.03.2034	181.301	0,17
400.000	Manchester Airport Group Funding Plc 'EMTN'	2,88 %	30.09.2044	253.631	0,24
100.000	Martlet Homes Ltd	3,00 %	09.05.2052	65.220	0,06
200.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	3,75 %	16.07.2026	187.761	0,18
157.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	4,38 %	08.02.2027	148.300	0,14
300.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	1,75 %	03.07.2029	240.545	0,23
450.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	2,38 %	14.03.2032	356.141	0,33

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 49,58 %) (Fortsetzung)					
614.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	3,63 %	10.03.2036	510.377	0,48
330.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	2,38 %	03.07.2039	222.768	0,21
300.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	1,50 %	20.01.2041	170.446	0,16
400.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	2,13 %	18.01.2042	249.299	0,23
350.000	National Grid Electricity Distribution Plc	3,50 %	16.10.2026	317.839	0,30
200.000	National Grid Electricity Distribution West Midlands Plc 'EMTN'	3,88 %	17.10.2024	193.439	0,18
670.000	National Grid Electricity Distribution West Midlands Plc 'EMTN'	5,75 %	16.04.2032	654.417	0,61
250.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN'	4,00 %	08.06.2027	228.480	0,21
700.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN'	2,00 %	17.04.2040	409.748	0,38
150.000	Nationwide Building Society 'EMTN'	3,25 %	20.01.2028	133.246	0,12
600.000	Nationwide Building Society FRN	6,18 %	07.12.2027	581.525	0,54
200.000	Nats En Route Plc	1,75 %	30.09.2033	140.229	0,13
450.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN	2,88 %	19.09.2026	408.330	0,38
332.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN	3,62 %	29.03.2029	285.471	0,27
550.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN	2,11 %	28.11.2031	452.523	0,42
120.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN	7,42 %	06.06.2033	116.367	0,11
900.000	NatWest Group Plc FRN	2,06 %	09.11.2028	733.911	0,69
400.000	NatWest Group Plc FRN	3,62 %	14.08.2030	368.479	0,35
166.000	NatWest Markets Plc 'EMTN'	6,63 %	22.06.2026	164.518	0,15
150.000	Northumbrian Water Finance Plc	1,63 %	11.10.2026	128.127	0,12
130.000	Northumbrian Water Finance Plc	5,63 %	29.04.2033	124.448	0,12
200.000	Northumbrian Water Finance Plc	5,13 %	23.01.2042	177.132	0,17
250.000	Northumbrian Water Finance Plc 'EMTN'	6,38 %	28.10.2034	250.922	0,24
150.000	Notting Hill Genesis	3,75 %	20.12.2032	127.904	0,12
100.000	Notting Hill Genesis	5,25 %	07.07.2042	92.828	0,09
250.000	Notting Hill Genesis	3,25 %	12.10.2048	166.419	0,16
248.000	Peabody Capital No 2 Plc	2,75 %	02.03.2034	189.271	0,18
240.000	Peabody Capital No 2 Plc	4,63 %	12.12.2053	204.927	0,19
400.000	Pension Insurance Corp Plc	5,63 %	20.09.2030	346.919	0,32
386.000	Pension Insurance Corp Plc	3,63 %	21.10.2032	279.828	0,26
100.000	Phoenix Group Holdings Plc	6,63 %	18.12.2025	97.716	0,09

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 49,58 %) (Fortsetzung)					
360.000	Phoenix Group Holdings Plc	5,87 %	13.06.2029	322.386	0,30
400.000	Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN'	5,63 %	28.04.2031	348.272	0,33
250.000	RI Finance Bonds No 3 Plc	6,13 %	13.11.2028	232.991	0,22
250.000	RL Finance Bonds NO 4 Plc FRN	4,88 %	07.10.2049	182.083	0,17
234.000	Rothsay Life Plc	3,38 %	12.07.2026	207.881	0,19
200.000	Rothsay Life Plc 'EMTN'	7,73 %	16.05.2033	191.700	0,18
280.000	Rothsay Life Plc FRN	5,50 %	17.09.2029	271.821	0,25
170.000	Sage Group Plc/The	2,88 %	08.02.2034	128.012	0,12
200.000	Sanctuary Capital Plc	6,70 %	23.03.2039	222.698	0,21
100.000	Sanctuary Capital Plc 'EMTN'	5,00 %	26.04.2047	91.317	0,09
400.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN'	3,63 %	14.01.2026	365.755	0,34
572.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN' FRN	7,10 %	16.11.2027	561.732	0,53
600.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN' FRN	2,42 %	17.01.2029	488.286	0,46
200.000	Scottish Hydro Electric Transmission Plc 'EMTN'	2,25 %	27.09.2035	138.361	0,13
100.000	Segro Plc	2,38 %	11.10.2029	80.764	0,08
300.000	Segro Plc	2,88 %	11.10.2037	211.481	0,20
350.000	Segro Plc 'EMTN'	5,13 %	06.12.2041	317.919	0,30
160.000	Severn Trent Utilities Finance Plc	6,13 %	26.02.2024	159.669	0,15
490.000	Severn Trent Utilities Finance Plc	6,25 %	07.06.2029	484.415	0,45
500.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	2,75 %	05.12.2031	394.267	0,37
100.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	2,63 %	22.02.2033	75.545	0,07
369.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	2,00 %	02.06.2040	215.197	0,20
200.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,88 %	24.01.2042	175.259	0,16
200.000	Sky Ltd 'EMTN'	6,00 %	21.05.2027	199.197	0,19
400.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	5,63 %	30.09.2030	392.448	0,37
200.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	6,38 %	12.11.2031	206.092	0,19
350.000	Southern Electric Power Distribution Plc	5,50 %	07.06.2032	343.300	0,32
200.000	Southern Gas Networks Plc 'EMTN'	2,50 %	03.02.2025	188.041	0,18
340.000	Southern Gas Networks Plc 'EMTN'	3,10 %	15.09.2036	244.866	0,23
300.000	Southern Housing	2,38 %	08.10.2036	205.772	0,19
300.000	Southern Housing	3,50 %	19.10.2047	209.165	0,20

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 49,58 %) (Fortsetzung)					
500.000	SSE Plc FRN (Perpetual)	3,74 %	14.01.2026	452.714	0,42
100.000	Standard Chartered Plc 'EMTN'	4,38 %	18.01.2038	88.744	0,08
500.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN'	2,75 %	27.04.2030	403.654	0,38
150.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,00 %	19.06.2025	138.901	0,13
200.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	6,75 %	16.11.2028	197.332	0,18
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,38 %	03.07.2034	80.717	0,08
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	5,13 %	28.09.2037	83.642	0,08
150.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	2,38 %	22.04.2040	86.128	0,08
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	5,50 %	11.02.2041	86.679	0,08
120.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	7,74 %	09.04.2058	138.279	0,13
100.000	THFC Funding No 2 Plc 'EMTN'	6,35 %	08.07.2039	106.697	0,10
350.000	THFC Funding No 3 Plc 'EMTN'	5,20 %	11.10.2043	326.252	0,31
200.000	Unilever Plc	1,50 %	22.07.2026	177.108	0,17
100.000	Unilever Plc 'EMTN'	2,13 %	28.02.2028	86.233	0,08
200.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	2,00 %	14.02.2025	186.709	0,17
500.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	2,63 %	12.02.2031	401.877	0,38
200.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	2,00 %	03.07.2033	142.495	0,13
108.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	5,75 %	26.06.2036	106.341	0,10
100.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	5,13 %	06.10.2038	91.926	0,09
200.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	1,88 %	03.06.2042	109.921	0,10
13.000	United Utilities Water Ltd 'EMTN'	5,63 %	20.12.2027	12.643	0,01
400.000	Virgin Money UK Plc 'EMTN' FRN	4,00 %	25.09.2026	361.733	0,34
500.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN	3,13 %	22.06.2025	474.367	0,44
200.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN	3,38 %	24.04.2026	182.053	0,17
339.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN	4,00 %	03.09.2027	296.776	0,28
269.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN	5,13 %	11.12.2030	241.834	0,23
230.000	Vodafone Group Plc 'EMTN'	5,90 %	26.11.2032	228.565	0,21
390.000	Vodafone Group Plc 'EMTN'	3,38 %	08.08.2049	247.151	0,23
257.000	Vodafone Group Plc 'EMTN'	5,13 %	02.12.2052	217.765	0,20
520.000	Vodafone Group Plc 'EMTN'	3,00 %	12.08.2056	289.441	0,27
100.000	Wellcome Trust Finance Plc	4,63 %	25.07.2036	96.120	0,09

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 49,58 %) (Fortsetzung)					
200.000	Wellcome Trust Ltd/The	4,00 %	09.05.2059	173.147	0,16
452.000	Wellcome Trust Ltd/The	1,50 %	14.07.2071	178.711	0,17
400.000	Wellcome Trust Ltd/The	2,52 %	07.02.2118	207.238	0,19
212.000	Whitbread Group Plc	3,38 %	16.10.2025	194.370	0,18
200.000	Whitbread Group Plc	2,38 %	31.05.2027	166.509	0,16
600.000	Yorkshire Building Society 'EMTN'	3,50 %	21.04.2026	551.428	0,52
200.000	Yorkshire Building Society FRN	6,38 %	15.11.2028	190.458	0,18
300.000	Yorkshire Building Society FRN	3,51 %	11.10.2030	245.854	0,23
164.000	Yorkshire Water Finance Plc	6,38 %	19.08.2039	167.184	0,16
150.000	Yorkshire Water Finance Plc 'EMTN'	1,75 %	27.10.2032	104.625	0,10
200.000	Yorkshire Water Finance Plc 'EMTN'	2,75 %	18.04.2041	128.024	0,12
Vereinigtes Königreich insgesamt				52.284.845	48,99
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 18,76 %)					
130.000	American Honda Finance Corp	0,75 %	25.11.2026	108.827	0,10
400.000	Amgen Inc	5,50 %	07.12.2026	389.492	0,37
250.000	Apple Inc	3,05 %	31.07.2029	220.852	0,21
150.000	Apple Inc	3,60 %	31.07.2042	124.447	0,12
150.000	AT&T Inc	5,50 %	15.03.2027	144.273	0,14
500.000	AT&T Inc	4,38 %	14.09.2029	450.847	0,42
650.000	AT&T Inc	4,25 %	01.06.2043	496.913	0,47
500.000	AT&T Inc	4,88 %	01.06.2044	414.244	0,39
750.000	AT&T Inc 'EMTN'	7,00 %	30.04.2040	791.220	0,74
660.000	Bank of America Corp 'EMTN'	2,30 %	25.07.2025	606.124	0,57
458.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN	1,67 %	02.06.2029	365.792	0,34
240.000	Bank of America Corp FRN	3,58 %	27.04.2031	203.381	0,19
300.000	Citigroup Inc	2,75 %	24.01.2024	294.422	0,28
500.000	Citigroup Inc	1,75 %	23.10.2026	430.815	0,40
200.000	Citigroup Inc 'EMTN'	6,80 %	25.06.2038	220.983	0,21
150.000	Citigroup Inc 'EMTN'	7,38 %	01.09.2039	176.681	0,17
400.000	Comcast Corp	5,50 %	23.11.2029	394.079	0,37

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 18,76 %) (Fortsetzung)					
300.000	Comcast Corp	1,88 %	20.02.2036	200.546	0,19
200.000	Digital Stout Holding LLC	3,30 %	19.07.2029	161.799	0,15
400.000	Digital Stout Holding LLC	3,75 %	17.10.2030	326.421	0,31
200.000	Fiserv Inc	2,25 %	01.07.2025	183.619	0,17
305.000	General Motors Financial Co Inc	1,55 %	30.07.2027	249.071	0,23
400.000	General Motors Financial Co Inc 'EMTN'	2,35 %	03.09.2025	363.465	0,34
200.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	4,25 %	29.01.2026	188.708	0,18
278.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	1,50 %	07.12.2027	225.137	0,21
500.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	3,13 %	25.07.2029	418.269	0,39
141.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	1,88 %	16.12.2030	104.691	0,10
150.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN	1,00 %	16.12.2025	138.471	0,13
479.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN	3,63 %	29.10.2029	413.820	0,39
200.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'GMTN'	7,25 %	10.04.2028	204.992	0,19
400.000	International Business Machines Corp	4,88 %	06.02.2038	356.413	0,33
250.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN'	3,50 %	18.12.2026	229.287	0,21
200.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN	1,90 %	28.04.2033	145.174	0,14
559.000	JPMorgan Chase & Co FRN	0,99 %	28.04.2026	506.100	0,47
200.000	McDonald's Corp 'GMTN'	3,75 %	31.05.2038	159.749	0,15
550.000	Metropolitan Life Global Funding I	0,63 %	08.12.2027	431.535	0,40
480.000	Metropolitan Life Global Funding I	5,00 %	10.01.2030	455.221	0,43
467.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	1,63 %	12.10.2028	373.747	0,35
547.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	1,63 %	21.09.2029	421.531	0,40
550.000	Morgan Stanley FRN	5,79 %	18.11.2033	527.864	0,49
400.000	Morgan Stanley 'GMTN'	2,63 %	09.03.2027	350.005	0,33
357.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	2,50 %	04.04.2032	290.365	0,27
131.000	New York Life Global Funding 'EMTN'	4,35 %	16.09.2025	125.147	0,12
233.000	New York Life Global Funding 'EMTN'	1,50 %	15.07.2027	195.072	0,18
300.000	New York Life Global Funding 'GMTN'	1,25 %	17.12.2026	253.365	0,24
577.000	New York Life Global Funding 'GMTN'	0,75 %	14.12.2028	441.724	0,41
200.000	PepsiCo Inc	3,20 %	22.07.2029	175.667	0,16
100.000	PepsiCo Inc	3,55 %	22.07.2034	85.101	0,08

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 97,94 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 18,76 %) (Fortsetzung)					
100.000	Pfizer Inc	6,50 %	03.06.2038	111.093	0,10
180.000	Pfizer Inc 'REGS'	2,74 %	15.06.2043	122.789	0,12
300.000	Realty Income Corp	1,13 %	13.07.2027	240.433	0,23
250.000	Realty Income Corp 'EMTN'	1,63 %	15.12.2030	181.460	0,17
341.000	Time Warner Cable LLC	5,75 %	02.06.2031	312.288	0,29
100.000	Time Warner Cable LLC	5,25 %	15.07.2042	79.128	0,07
400.000	Toyota Motor Credit Corp	0,75 %	19.11.2026	334.845	0,31
100.000	Verizon Communications Inc	4,07 %	18.06.2024	98.265	0,09
300.000	Verizon Communications Inc	1,88 %	19.09.2030	229.057	0,21
300.000	Verizon Communications Inc	2,50 %	08.04.2031	236.917	0,22
700.000	Verizon Communications Inc	3,38 %	27.10.2036	531.984	0,50
150.000	Verizon Communications Inc	1,88 %	03.11.2038	88.899	0,08
100.000	Verizon Communications Inc 'EMTN'	4,75 %	17.02.2034	90.395	0,08
28.000	Walmart Inc	5,75 %	19.12.2030	28.948	0,03
320.000	Walmart Inc	5,63 %	27.03.2034	330.507	0,31
150.000	Walmart Inc	5,25 %	28.09.2035	150.261	0,14
150.000	Walmart Inc	4,88 %	19.01.2039	144.241	0,14
300.000	Wells Fargo & Co	4,63 %	02.11.2035	265.186	0,25
500.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,00 %	28.07.2025	453.769	0,43
500.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,50 %	02.05.2029	400.280	0,38
262.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,13 %	24.09.2031	194.022	0,18
520.000	Welltower OP LLC	4,80 %	20.11.2028	468.845	0,44
200.000	Welltower OP LLC	4,50 %	01.12.2034	164.069	0,15
Vereinigte Staaten insgesamt				19.793.149	18,55
Unternehmensanleihen insgesamt				104.780.799	98,18

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen	Wert £	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen	104.780.799	98,18
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.941.153	1,82
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	106.721.952	100,00

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	98,16
Sonstige Vermögenswerte	1,84
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %)					
Argentinien (30. Juni 2022: 0,53 %)					
4.518.542	Argentine Republic Government International Bond	1,00 %	09.07.2029	1.465.544	0,55
10.435.000	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon	0,75 %	09.07.2030	3.460.976	1,28
Argentinien insgesamt				4.926.520	1,83
Armenien (30. Juni 2022: 0,25 %)					
800.000	Republic of Armenia International Bond 'REGS'	7,15 %	26.03.2025	807.048	0,30
Armenien insgesamt				807.048	0,30
Aserbaidshon (30. Juni 2022: 0,43 %)					
550.000	Republic of Azerbaijan International Bond 'REGS'	4,75 %	18.03.2024	543.164	0,20
Aserbaidshon insgesamt				543.164	0,20
Bahrain (30. Juni 2022: – %)					
1.130.000	Bahrain Government International Bond 'REGS'	4,25 %	25.01.2028	1.039.498	0,38
970.000	CBB International Sukuk Co 5 Spc 'REGS'	5,62 %	12.02.2024	961.464	0,36
1.900.000	CBB International Sukuk Co 7 SPC 'REGS'	6,88 %	05.10.2025	1.936.271	0,72
1.868.000	CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS'	6,25 %	14.11.2024	1.863.835	0,69
951.000	CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS'	4,50 %	30.03.2027	905.704	0,34
910.000	CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS'	3,95 %	16.09.2027	848.302	0,31
Bahrain insgesamt				7.555.074	2,80
Barbados (30. Juni 2022: 0,48 %)					
1.070.000	Barbados Government International Bond 'REGS'	6,50 %	01.10.2029	997.764	0,37
Summe Barbados				997.764	0,37
Bolivien (30. Juni 2022: 0,48 %)					
900.000	Bolivian Government International Bond 'REGS'	4,50 %	20.03.2028	569.259	0,21
Gesamt Bolivien				569.259	0,21

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Brasilien (30. Juni 2022: 3,58 %)					
3.700.000	Brazilian Government International Bond	4,25 %	07.01.2025	3.626.925	1,34
335.000	Brazilian Government International Bond	8,75 %	04.02.2025	353.418	0,13
1.500.000	Brazilian Government International Bond	2,88 %	06.06.2025	1.426.260	0,53
2.450.000	Brazilian Government International Bond	6,00 %	07.04.2026	2.505.591	0,93
321.000	Brazilian Government International Bond	10,13 %	15.05.2027	375.326	0,14
1.900.000	Brazilian Government International Bond	4,63 %	13.01.2028	1.845.204	0,68
Brasilien insgesamt				10.132.724	3,75
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: – %)					
2.060.000	KSA Sukuk Ltd 'REGS'	3,63 %	20.04.2027	1.967.568	0,73
800.000	RAK Capital 'EMTN'	3,09 %	31.03.2025	770.792	0,29
900.000	Sharjah Sukuk Program Ltd 'EMTN'	3,85 %	03.04.2026	864.081	0,32
800.000	Sharjah Sukuk Program Ltd 'EMTN'	4,23 %	14.03.2028	759.632	0,28
Cayman-Inseln insgesamt				4.362.073	1,62
Chile (30. Juni 2022: 1,67 %)					
2.150.000	Chile Government International Bond	3,13 %	21.01.2026	2.056.153	0,76
2.325.000	Chile Government International Bond	2,75 %	31.01.2027	2.155.693	0,80
3.368.000	Chile Government International Bond	3,24 %	06.02.2028	3.158.544	1,17
Chile insgesamt				7.370.390	2,73
China (30. Juni 2022: 0,97 %)					
2.100.000	China Government International Bond	1,95 %	03.12.2024	2.010.582	0,74
400.000	China Government International Bond	2,63 %	02.11.2027	375.028	0,14
China insgesamt				2.385.610	0,88
Kolumbien (30. Juni 2022: 2,33 %)					
2.000.000	Colombia Government International Bond	4,00 %	26.02.2024	1.966.360	0,73
2.080.000	Colombia Government International Bond	4,50 %	28.01.2026	1.974.502	0,73

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Kolumbien (30. Juni 2022: 2,33 %) (Fortsetzung)					
2.350.000	Colombia Government International Bond	3,88 %	25.04.2027	2.127.385	0,79
Kolumbien insgesamt				6.068.247	2,25
Costa Rica (30. Juni 2022: 0,98 %)					
1.000.000	Costa Rica Government International Bond 'REGS'	4,38 %	30.04.2025	974.540	0,36
Costa Rica insgesamt				974.540	0,36
Cote d'Ivoire (Elfenbeinkünste) (30. Juni 2022: 0,28 %)					
450.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS'	6,38 %	03.03.2028	432.680	0,16
Summe Cote d'Ivoire (Elfenbeinkünste)				432.680	0,16
Kroatien (30. Juni 2022: 2,98 %)					
3.300.000	Croatia Government International Bond 'REGS'	6,00 %	26.01.2024	3.293.730	1,22
Kroatien insgesamt				3.293.730	1,22
Dominikanische Republik (30. Juni 2022: 2,46 %)					
1.268.000	Dominican Republic International Bond 'REGS'	5,50 %	27.01.2025	1.246.837	0,46
3.055.000	Dominican Republic International Bond 'REGS'	6,88 %	29.01.2026	3.075.713	1,14
1.660.000	Dominican Republic International Bond 'REGS'	5,95 %	25.01.2027	1.623.181	0,60
Dominikanische Republik insgesamt				5.945.731	2,20
Ecuador (30. Juni 2022: – %)					
1.280.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon)	0,00 %	31.07.2030	366.041	0,14
4.320.000	Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS'	5,50 %	31.07.2030	2.079.778	0,77
Ecuador insgesamt				2.445.819	0,91
Ägypten (30. Juni 2022: 2,39 %)					
700.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	6,20 %	01.03.2024	654.878	0,24
1.691.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	5,75 %	29.05.2024	1.524.673	0,56

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Ägypten (30. Juni 2022: 2,39 %) (Fortsetzung)					
1.400.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	3,88 %	16.02.2026	982.996	0,36
1.300.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	7,50 %	31.01.2027	941.993	0,35
1.450.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	5,80 %	30.09.2027	960.408	0,36
200.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	6,59 %	21.02.2028	130.548	0,05
Ägypten insgesamt				5.195.496	1,92
El Salvador (30. Juni 2022: 0,62 %)					
700.000	El Salvador Government International Bond 'REGS'	6,38 %	18.01.2027	482.062	0,18
El Salvador insgesamt				482.062	0,18
Gabun (30. Juni 2022: 0,43 %)					
650.000	Gabon Government International Bond 'REGS'	6,95 %	16.06.2025	609.512	0,23
Gabun insgesamt				609.512	0,23
Georgien (30. Juni 2022: 0,21 %)					
800.000	Georgia Government International Bond 'REGS'	2,75 %	22.04.2026	716.672	0,27
Georgien insgesamt				716.672	0,27
Ghana (30. Juni 2022: 1,17 %)					
400.000	Ghana Government International Bond 'REGS'	0,00 %	07.04.2025	151.632	0,06
900.000	Ghana Government International Bond 'REGS'	8,13 %	18.01.2026	403.749	0,15
2.750.000	Ghana Government International Bond 'REGS'	6,38 %	11.02.2027	1.183.270	0,44
280.000	Ghana Government International Bond 'REGS'	7,88 %	26.03.2027	122.741	0,04
900.000	Ghana Government International Bond 'REGS'	7,75 %	07.04.2029	380.700	0,14
1.480.000	Ghana Government International Bond 'REGS'	7,63 %	16.05.2029	627.831	0,23
Ghana insgesamt				2.869.923	1,06
Guatemala (30. Juni 2022: 0,24 %)					
600.000	Guatemala Government Bond 'REGS'	4,50 %	03.05.2026	572.412	0,21
600.000	Guatemala Government Bond 'REGS'	4,38 %	05.06.2027	566.094	0,21

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Guatemala (30. Juni 2022: 0,24 %) (Fortsetzung)					
600.000	Guatemala Government Bond 'REGS'	4,88 %	13.02.2028	569.220	0,21
Guatemala insgesamt				1.707.726	0,63
Honduras (30. Juni 2022: – %)					
450.000	Honduras Government International Bond 'REGS'	6,25 %	19.01.2027	408.649	0,15
Honduras insgesamt				408.649	0,15
Ungarn (30. Juni 2022: 2,83 %)					
1.510.000	Hungary Government International Bond	5,75 %	22.11.2023	1.508.400	0,56
2.828.000	Hungary Government International Bond	5,38 %	25.03.2024	2.816.688	1,04
3.686.000	Hungary Government International Bond 'REGS'	6,13 %	22.05.2028	3.743.096	1,39
2.827.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 'REGS'	6,13 %	04.12.2027	2.790.588	1,03
Ungarn insgesamt				10.858.772	4,02
Indien (30. Juni 2022: 0,36 %)					
1.200.000	Export-Import Bank of India 'REGS'	3,38 %	05.08.2026	1.126.320	0,42
900.000	Export-Import Bank of India 'REGS'	3,88 %	01.02.2028	846.306	0,31
Indien insgesamt				1.972.626	0,73
Indonesien (30. Juni 2022: 2,02 %)					
750.000	Indonesia Government International Bond	4,15 %	20.09.2027	726.165	0,27
1.595.000	Indonesia Government International Bond	4,55 %	11.01.2028	1.568.810	0,58
900.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'	5,88 %	15.01.2024	902.394	0,33
400.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'	4,13 %	15.01.2025	392.608	0,15
1.200.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'	4,75 %	08.01.2026	1.197.792	0,44
400.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'	3,85 %	18.07.2027	382.920	0,14
1.000.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	4,35 %	10.09.2024	989.010	0,37
1.600.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	4,33 %	28.05.2025	1.580.064	0,58
1.460.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	4,55 %	29.03.2026	1.450.554	0,54
596.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	1,50 %	09.06.2026	540.560	0,20

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Indonesien (30. Juni 2022: 2,02 %) (Fortsetzung)					
850.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	4,15 %	29.03.2027	831.716	0,31
400.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	4,40 %	01.03.2028	393.012	0,15
Indonesien insgesamt				10.955.605	4,06
Jamaica (30. Juni 2022: 1,14 %)					
2.480.000	Jamaica Government International Bond	6,75 %	28.04.2028	2.587.830	0,96
Summe Jamaica				2.587.830	0,96
Jordanien (30. Juni 2022: 1,24 %)					
1.480.000	Jordan Government International Bond 'REGS'	6,13 %	29.01.2026	1.450.223	0,54
310.000	Jordan Government International Bond 'REGS'	5,75 %	31.01.2027	297.510	0,11
920.000	Jordan Government International Bond 'REGS'	7,75 %	15.01.2028	936.302	0,34
Jordanien insgesamt				2.684.035	0,99
Kasachstan (30. Juni 2022: 2,03 %)					
3.115.000	Kazakhstan Government International Bond 'REGS'	3,88 %	14.10.2024	3.105.437	1,15
3.995.000	Kazakhstan Government International Bond 'REGS'	5,13 %	21.07.2025	4.096.033	1,52
Kasachstan insgesamt				7.201.470	2,67
Kenia (30. Juni 2022: 0,83 %)					
2.325.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS'	6,88 %	24.06.2024	2.202.356	0,82
700.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS'	7,00 %	22.05.2027	628.537	0,23
400.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS'	7,25 %	28.02.2028	345.800	0,13
Kenia insgesamt				3.176.693	1,18
Kuwait (30. Juni 2022: 2,44 %)					
6.030.000	Kuwait International Government Bond 'REGS'	3,50 %	20.03.2027	5.822.749	2,16
Kuwait insgesamt				5.822.749	2,16

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Malaysia (30. Juni 2022: – %)					
1.880.000	Malaysia Sovereign Sukuk Bhd 'REGS'	3,04 %	22.04.2025	1.811.493	0,67
1.000.000	Malaysia Sukuk Global Bhd 'REGS'	3,18 %	27.04.2026	954.090	0,35
Malaysia insgesamt				2.765.583	1,02
Mexiko (30. Juni 2022: 1,25 %)					
1.350.000	Mexico Government International Bond	4,13 %	21.01.2026	1.325.686	0,49
1.904.000	Mexico Government International Bond	4,15 %	28.03.2027	1.864.435	0,69
1.300.000	Mexico Government International Bond	5,40 %	09.02.2028	1.319.968	0,49
Mexiko insgesamt				4.510.089	1,67
Mongolei (30. Juni 2022: 1,47 %)					
900.000	Mongolia Government International Bond 'REGS'	5,13 %	07.04.2026	839.160	0,31
1.000.000	Mongolia Government International Bond 'REGS'	3,50 %	07.07.2027	840.430	0,31
1.170.000	Mongolia Government International Bond 'REGS'	8,65 %	19.01.2028	1.180.741	0,44
Mongolei insgesamt				2.860.331	1,06
Marokko (30. Juni 2022: 0,80 %)					
800.000	Morocco Government International Bond 'REGS'	2,38 %	15.12.2027	697.680	0,26
1.901.000	Morocco Government International Bond 'REGS'	5,95 %	08.03.2028	1.916.873	0,71
Marokko insgesamt				2.614.553	0,97
Namibia (30. Juni 2022: 0,44 %)					
1.200.000	Namibia International Bonds 'REGS'	5,25 %	29.10.2025	1.134.000	0,42
Namibia insgesamt				1.134.000	0,42
Oman (30. Juni 2022: 3,86 %)					
1.150.000	Oman Government International Bond 'REGS'	4,88 %	01.02.2025	1.130.496	0,42
2.050.000	Oman Government International Bond 'REGS'	4,75 %	15.06.2026	1.989.791	0,74
1.460.000	Oman Government International Bond 'REGS'	5,38 %	08.03.2027	1.429.939	0,53
2.180.000	Oman Government International Bond 'REGS'	6,75 %	28.10.2027	2.250.174	0,83

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Oman (30. Juni 2022: 3,86 %) (Fortsetzung)					
1.350.000	Oman Government International Bond 'REGS'	5,63 %	17.01.2028	1.332.153	0,49
1.325.000	Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS'	4,40 %	01.06.2024	1.301.468	0,48
1.250.000	Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS'	5,93 %	31.10.2025	1.263.663	0,47
Oman insgesamt				10.697.684	3,96
Panama (30. Juni 2022: 2,30 %)					
2.321.000	Panama Government International Bond	3,75 %	16.03.2025	2.242.829	0,83
2.100.000	Panama Government International Bond	7,13 %	29.01.2026	2.187.150	0,81
1.300.000	Panama Government International Bond	8,88 %	30.09.2027	1.488.162	0,55
2.350.000	Panama Government International Bond	3,88 %	17.03.2028	2.222.865	0,83
Panama insgesamt				8.141.006	3,02
Paraguay (30. Juni 2022: 0,56 %)					
1.040.000	Paraguay Government International Bond 'REGS'	5,00 %	15.04.2026	1.031.098	0,38
400.000	Paraguay Government International Bond 'REGS'	4,70 %	27.03.2027	388.040	0,15
Paraguay insgesamt				1.419.138	0,53
Peru (30. Juni 2022: 1,84 %)					
775.000	Corp Financiera de Desarrollo SA 'REGS'	2,40 %	28.09.2027	676.962	0,25
500.000	Fondo MIVIVIENDA SA 'REGS'	4,63 %	12.04.2027	484.055	0,18
1.196.000	Peruvian Government International Bond	7,35 %	21.07.2025	1.239.307	0,46
1.170.000	Peruvian Government International Bond	2,39 %	23.01.2026	1.087.936	0,40
1.620.000	Peruvian Government International Bond	4,13 %	25.08.2027	1.576.795	0,59
Peru insgesamt				5.065.055	1,88
Philippinen (30. Juni 2022: 2,95 %)					
1.548.000	Philippine Government International Bond	4,20 %	21.01.2024	1.535.786	0,57
2.080.000	Philippine Government International Bond	10,63 %	16.03.2025	2.272.005	0,84
1.089.000	Philippine Government International Bond	5,50 %	30.03.2026	1.106.195	0,41
800.000	Philippine Government International Bond	3,23 %	29.03.2027	755.128	0,28

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Philippinen (30. Juni 2022: 2,95 %) (Fortsetzung)					
600.000	Philippine Government International Bond	5,17 %	13.10.2027	607.464	0,22
1.650.000	Philippine Government International Bond	3,00 %	01.02.2028	1.531.299	0,57
Philippinen insgesamt				7.807.877	2,89
Polen (30. Juni 2022: 5,22 %)					
3.523.000	Republic of Poland Government International Bond	4,00 %	22.01.2024	3.492.491	1,30
4.130.000	Republic of Poland Government International Bond	3,25 %	06.04.2026	3.977.810	1,47
1.845.000	Republic of Poland Government International Bond	5,50 %	16.11.2027	1.890.276	0,70
Polen insgesamt				9.360.577	3,47
Katar (30. Juni 2022: 3,38 %)					
820.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,38 %	14.03.2024	806.322	0,30
2.082.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,40 %	16.04.2025	2.019.582	0,75
4.500.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,25 %	02.06.2026	4.307.130	1,59
1.000.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	4,50 %	23.04.2028	998.110	0,37
Katar insgesamt				8.131.144	3,01
Rumänien (30. Juni 2022: 2,48 %)					
2.076.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	4,88 %	22.01.2024	2.064.665	0,77
2.026.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	3,00 %	27.02.2027	1.831.504	0,68
880.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	5,25 %	25.11.2027	858.027	0,32
2.924.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	6,63 %	17.02.2028	3.006.749	1,11
Rumänien insgesamt				7.760.945	2,88
Saudi-Arabien (30. Juni 2022: 3,90 %)					
2.459.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	4,00 %	17.04.2025	2.402.591	0,89
1.025.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	2,90 %	22.10.2025	975.287	0,36
2.250.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	3,25 %	26.10.2026	2.128.568	0,79
650.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	2,50 %	03.02.2027	598.344	0,22
1.983.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	4,75 %	18.01.2028	1.962.773	0,73

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Saudi-Arabien (30. Juni 2022: 3,90 %) (Fortsetzung)					
1.500.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	3,63 %	04.03.2028	1.419.525	0,52
Saudi-Arabien insgesamt				9.487.088	3,51
Serbien (30. Juni 2022: – %)					
1.100.000	Serbia International Bond 'REGS'	6,25 %	26.05.2028	1.093.037	0,40
Serbien insgesamt				1.093.037	0,40
Südafrika (30. Juni 2022: 2,42 %)					
1.710.000	Republic of South Africa Government International Bond	4,67 %	17.01.2024	1.691.771	0,63
3.250.000	Republic of South Africa Government International Bond	5,88 %	16.09.2025	3.206.710	1,19
800.000	Republic of South Africa Government International Bond	4,88 %	14.04.2026	764.264	0,28
1.326.000	Republic of South Africa Government International Bond	4,85 %	27.09.2027	1.240.168	0,46
Südafrika insgesamt				6.902.913	2,56
Sri Lanka (30. Juni 2022: 0,72 %)					
700.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	0,00 %	18.04.2023	307.146	0,12
856.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	6,85 %	14.03.2024	374.791	0,14
600.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	6,13 %	03.06.2025	278.970	0,10
1.120.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	6,85 %	03.11.2025	517.843	0,19
1.200.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	6,83 %	18.07.2026	546.720	0,20
1.100.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	6,20 %	11.05.2027	478.500	0,18
Sri Lanka insgesamt				2.503.970	0,93
Surinam (30. Juni 2022: 0,18 %)					
500.000	Suriname Government International Bond 'REGS'	9,25 %	26.10.2026	374.730	0,14
Surinam insgesamt				374.730	0,14
Trinidad und Tobago (30. Juni 2022: 0,87 %)					
850.000	Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS'	4,38 %	16.01.2024	837.735	0,31

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Trinidad und Tobago (30. Juni 2022: 0,87 %) (Fortsetzung)					
1.190.000	Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS'	4,50 %	04.08.2026	1.154.002	0,43
Trinidad und Tobago insgesamt				1.991.737	0,74
Tunesien (30. Juni 2022: 0,41 %)					
1.272.000	Tunisian Republic 'REGS'	5,75 %	30.01.2025	842.420	0,31
Tunesien insgesamt				842.420	0,31
Türkei (30. Juni 2022: 3,58 %)					
1.949.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS'	9,76 %	13.11.2025	1.997.764	0,74
800.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS'	5,13 %	22.06.2026	732.384	0,27
1.700.000	Turkey Government International Bond	5,75 %	22.03.2024	1.670.301	0,62
750.000	Turkey Government International Bond	7,38 %	05.02.2025	738.038	0,27
850.000	Turkey Government International Bond	6,38 %	14.10.2025	809.684	0,30
800.000	Turkey Government International Bond	4,75 %	26.01.2026	728.808	0,27
800.000	Turkey Government International Bond	4,88 %	09.10.2026	712.824	0,26
450.000	Turkey Government International Bond	6,00 %	25.03.2027	408.375	0,15
700.000	Turkey Government International Bond	8,60 %	24.09.2027	686.952	0,26
1.092.000	Turkey Government International Bond	9,88 %	15.01.2028	1.110.564	0,41
300.000	Turkey Government International Bond	5,13 %	17.02.2028	260.265	0,10
600.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS 'REGS'	5,75 %	06.07.2026	540.810	0,20
Türkei insgesamt				10.396.769	3,85
Ukraine (30. Juni 2022: 0,65 %)					
2.800.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	7,75 %	01.09.2025	702.520	0,26
250.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	8,99 %	01.02.2026	62.093	0,02
620.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	7,75 %	01.09.2026	147.628	0,06
1.920.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	7,75 %	01.09.2027	454.176	0,17
1.725.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	7,75 %	01.09.2028	410.826	0,15
Ukraine insgesamt				1.777.243	0,66

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 81,05 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2022: 2,70 %)					
1.475.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	2,13 %	30.09.2024	1.415.853	0,53
3.000.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	2,50 %	16.04.2025	2.864.310	1,06
1.050.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	3,13 %	03.05.2026	1.004.892	0,37
3.180.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	3,13 %	11.10.2027	3.008.248	1,11
400.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	1,63 %	02.06.2028	350.664	0,13
Vereinigte Arabische Emirate insgesamt				8.643.967	3,20
Uruguay (30. Juni 2022: 1,97 %)					
586.667	Uruguay Government International Bond	4,50 %	14.08.2024	584.871	0,21
2.772.830	Uruguay Government International Bond	4,38 %	27.10.2027	2.748.956	1,02
Uruguay insgesamt				3.333.827	1,23
Usbekistan (30. Juni 2022: 0,24 %)					
600.000	Republic of Uzbekistan International Bond 'REGS'	4,75 %	20.02.2024	592.218	0,22
Usbekistan insgesamt				592.218	0,22
Vietnam (30. Juni 2022: 0,69 %)					
1.400.000	Vietnam Government International Bond 'REGS'	4,80 %	19.11.2024	1.370.908	0,51
Vietnam insgesamt				1.370.908	0,51
Sambia (30. Juni 2022: 0,65 %)					
425.000	Zambia Government International Bond 'REGS'	8,50 %	14.04.2024	246.305	0,09
1.350.000	Zambia Government International Bond 'REGS'	8,97 %	30.07.2027	774.508	0,29
Sambia insgesamt				1.020.813	0,38
Staatsanleihe insgesamt				238.659.815	88,42

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 17,31 %)					
Aserbaidsschan (30. Juni 2022: 0,74 %)					
2.500.000	Southern Gas Corridor CJSC 'REGS'	6,88 %	24.03.2026	2.533.775	0,94
Aserbaidsschan insgesamt				2.533.775	0,94
Bahrain (30. Juni 2022: 2,97 %)					
250.000	Oil and Gas Holding Co BSCC/The 'REGS'	7,50 %	25.10.2027	253.235	0,09
Bahrain insgesamt				253.235	0,09
Britische Jungferninseln (30. Juni 2022: 0,32 %)					
1.130.000	Sinochem Offshore Capital Co Ltd 'EMTN'	1,63 %	29.10.2025	1.022.526	0,38
Britische Jungferninseln insgesamt				1.022.526	0,38
Kanada (30. Juni 2022: – %)					
550.000	Petronas Energy Canada Ltd 'REGS'	2,11 %	23.03.2028	487.795	0,18
Kanada insgesamt				487.795	0,18
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 2,98 %)					
234.500	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais 'REGS'	5,33 %	15.02.2028	229.871	0,08
1.400.000	Gaci First Investment Co	5,00 %	13.10.2027	1.390.900	0,51
480.000	ICD Funding Ltd	3,22 %	28.04.2026	447.283	0,17
600.000	Mumtalakat Sukuk Holding Co	5,63 %	27.02.2024	594.126	0,22
800.000	Mumtalakat Sukuk Holding Co	4,10 %	21.01.2027	746.096	0,28
Cayman-Inseln insgesamt				3.408.276	1,26
Chile (30. Juni 2022: 0,71 %)					
600.000	Banco del Estado de Chile 'REGS'	2,70 %	09.01.2025	572.988	0,21
1.653.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS'	3,63 %	01.08.2027	1.558.068	0,58
550.000	Empresa Nacional del Petroleo 'REGS'	3,75 %	05.08.2026	520.476	0,19
Chile insgesamt				2.651.532	0,98

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 17,31 %) (Fortsetzung)					
Georgien (30. Juni 2022: – %)					
730.000	Georgian Railway JSC 'REGS'	4,00 %	17.06.2028	623.289	0,23
Georgien insgesamt				623.289	0,23
Indonesien (30. Juni 2022: 2,33 %)					
650.000	Pelabuhan Indonesia Persero PT 'REGS'	4,25 %	05.05.2025	635.388	0,24
600.000	Pertamina Persero PT 'REGS'	1,40 %	09.02.2026	540.450	0,20
Indonesien insgesamt				1.175.838	0,44
Kasachstan (30. Juni 2022: 1,60 %)					
600.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS'	5,75 %	12.05.2025	603.126	0,23
900.000	Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC 'REGS'	2,00 %	28.10.2026	814.788	0,30
550.000	QazaqGaz NC JSC 'REGS'	4,38 %	26.09.2027	510.675	0,19
Kasachstan insgesamt				1.928.589	0,72
Malaysia (30. Juni 2022: 1,78 %)					
850.000	Petroliam Nasional Bhd 'REGS'	7,63 %	15.10.2026	904.765	0,33
2.000.000	Petronas Capital Ltd 'REGS'	3,50 %	18.03.2025	1.933.360	0,72
Malaysia insgesamt				2.838.125	1,05
Mexiko (30. Juni 2022: 0,25 %)					
600.000	Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/Cayman Islands 'REGS'	4,38 %	14.10.2025	584.514	0,22
Mexiko insgesamt				584.514	0,22
Philippinen (30. Juni 2022: 0,54 %)					
1.860.000	Power Sector Assets & Liabilities Management Corp 'REGS'	7,39 %	02.12.2024	1.909.141	0,71
Philippinen insgesamt				1.909.141	0,71
Katar (30. Juni 2022: 0,70 %)					
1.600.000	QatarEnergy 'REGS'	1,38 %	12.09.2026	1.435.872	0,53
Katar insgesamt				1.435.872	0,53

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 17,31 %) (Fortsetzung)					
Trinidad und Tobago (30. Juni 2022: 0,42 %)					
1.750.000	Trinidad Generation UnLtd 'REGS'	5,25 %	04.11.2027	1.687.192	0,63
Trinidad und Tobago insgesamt				1.687.192	0,63
Türkei (30. Juni 2022: – %)					
200.000	TC Ziraat Bankasi AS 'REGS'	9,50 %	01.08.2026	198.174	0,07
Türkei insgesamt				198.174	0,07
Ukraine (30. Juni 2022: 0,20 %)					
950.000	NPC Ukrenergo 'REGS'	6,88 %	09.11.2028	195.805	0,07
Ukraine insgesamt				195.805	0,07
Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2022: 1,71 %)					
200.000	DAE Sukuk Difc Ltd 'REGS'	3,75 %	15.02.2026	189.286	0,07
1.000.000	Emirates Development Bank PJSC 'EMTN'	3,52 %	06.03.2024	981.090	0,36
1.220.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'GMTN'	2,50 %	21.05.2026	1.144.519	0,42
1.200.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS'	2,50 %	07.11.2024	1.150.524	0,43
Vereinigte Arabische Emirate insgesamt				3.465.419	1,28
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 0,07 %)					
600.000	Ukraine Railways Via Rail Capital Markets Plc	8,25 %	09.07.2026	225.000	0,08
Vereinigtes Königreich insgesamt				225.000	0,08
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: – %)					
400.000	DAE Funding LLC 'REGS'	1,55 %	01.08.2024	377.980	0,14
600.000	DAE Funding LLC 'REGS'	3,38 %	20.03.2028	537.306	0,20
Vereinigte Staaten insgesamt				915.286	0,34
Unternehmensanleihen insgesamt				27.539.383	10,20

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen				Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Staatsanleihe				238.659.815	88,42
Unternehmensanleihen				27.539.383	10,20

Anzahl der Kontrakte	Käufe	Verkäufe	Fälligkeits termin	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto- ver- mögens
Devisenterminkontrakte¹					
7	53.434.750 EUR	(57.176.983)USD	06.07.2023	1.126.940	0,42
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (30. Juni 2022: 0,00 %)				1.126.940	0,42
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten*				2.600.854	0,96
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen				269.926.992	100,00

Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden		98,05
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente		0,42
Sonstige Vermögenswerte		1,53
		100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

¹Der Kontrahent für die Devisenterminkontrakte ist die Bank of New York Mellon.

*In den sonstigen Vermögenswerten sind Anteile am LGIM Dollar Liquidity Fund mit einem Wert von 28.623 US\$ enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

L&G China CNY Bond UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 98,66 %)					
China (30. Juni 2022: 98,66 %)					
1.300.000	Agricultural Development Bank of China	3,19 %	03.03.2024	180.200	0,13
3.800.000	Agricultural Development Bank of China	3,51 %	03.04.2024	528.485	0,38
2.300.000	Agricultural Development Bank of China	2,78 %	21.07.2024	318.613	0,23
6.700.000	Agricultural Development Bank of China	3,24 %	14.08.2024	933.128	0,68
6.000.000	Agricultural Development Bank of China	4,98 %	12.01.2025	858.958	0,62
4.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,97 %	27.02.2025	565.349	0,41
1.300.000	Agricultural Development Bank of China	2,61 %	09.03.2025	179.880	0,13
5.200.000	Agricultural Development Bank of China	2,25 %	22.04.2025	714.888	0,52
5.600.000	Agricultural Development Bank of China	3,45 %	23.09.2025	788.673	0,57
5.850.000	Agricultural Development Bank of China	4,00 %	12.11.2025	834.516	0,60
4.720.000	Agricultural Development Bank of China	3,33 %	06.01.2026	664.517	0,48
4.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,37 %	26.02.2026	563.909	0,41
3.500.000	Agricultural Development Bank of China	3,35 %	24.03.2026	493.369	0,36
5.150.000	Agricultural Development Bank of China	3,58 %	22.04.2026	730.808	0,53
5.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,63 %	19.07.2026	712.230	0,52
4.200.000	Agricultural Development Bank of China	2,99 %	11.08.2026	587.639	0,43
5.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,85 %	06.01.2027	718.555	0,52
5.800.000	Agricultural Development Bank of China	2,74 %	23.02.2027	804.254	0,58
7.200.000	Agricultural Development Bank of China	2,50 %	24.08.2027	987.634	0,71
4.800.000	Agricultural Development Bank of China	4,39 %	08.09.2027	706.919	0,51
3.700.000	Agricultural Development Bank of China	3,48 %	04.02.2028	528.122	0,38
3.200.000	Agricultural Development Bank of China	2,90 %	08.03.2028	446.218	0,32
5.400.000	Agricultural Development Bank of China	4,65 %	11.05.2028	811.256	0,59
2.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,19 %	12.08.2028	281.814	0,20
6.140.000	Agricultural Development Bank of China	3,75 %	25.01.2029	890.341	0,64
4.800.000	Agricultural Development Bank of China	2,91 %	21.02.2029	666.590	0,48
7.300.000	Agricultural Development Bank of China	3,74 %	12.07.2029	1.060.103	0,77
7.200.000	Agricultural Development Bank of China	2,96 %	17.04.2030	1.002.812	0,73
8.100.000	Agricultural Development Bank of China	3,79 %	26.10.2030	1.189.061	0,86

L&G China CNY Bond UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
China (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
6.400.000	Agricultural Development Bank of China	3,52 %	24.05.2031	923.024	0,67
10.500.000	Agricultural Development Bank of China	3,30 %	05.11.2031	1.491.945	1,08
4.100.000	Agricultural Development Bank of China	3,06 %	06.06.2032	572.248	0,41
6.600.000	Agricultural Development Bank of China	2,97 %	14.10.2032	914.316	0,66
5.400.000	Agricultural Development Bank of China	3,10 %	27.02.2033	755.738	0,55
3.990.000	China Development Bank	3,30 %	01.02.2024	553.090	0,40
2.500.000	China Development Bank	3,00 %	17.06.2024	347.045	0,25
3.700.000	China Development Bank	3,42 %	02.07.2024	515.803	0,37
1.900.000	China Development Bank	4,30 %	21.08.2024	267.731	0,19
3.000.000	China Development Bank	2,73 %	11.11.2024	415.757	0,30
4.500.000	China Development Bank	3,23 %	10.01.2025	628.508	0,46
4.100.000	China Development Bank	3,81 %	05.02.2025	577.791	0,42
3.600.000	China Development Bank	4,73 %	02.04.2025	515.975	0,37
3.000.000	China Development Bank	4,21 %	13.04.2025	426.453	0,31
900.000	China Development Bank	2,89 %	22.06.2025	125.249	0,09
7.200.000	China Development Bank	3,34 %	14.07.2025	1.011.376	0,73
4.380.000	China Development Bank	3,74 %	10.09.2025	620.562	0,45
2.600.000	China Development Bank	4,15 %	26.10.2025	372.028	0,27
3.300.000	China Development Bank	3,68 %	26.02.2026	469.059	0,34
3.500.000	China Development Bank	3,30 %	03.03.2026	493.458	0,36
7.250.000	China Development Bank	3,18 %	05.04.2026	1.018.460	0,74
1.500.000	China Development Bank	3,50 %	13.08.2026	212.902	0,15
4.600.000	China Development Bank	3,05 %	25.08.2026	644.715	0,47
4.100.000	China Development Bank	2,83 %	10.09.2026	571.199	0,41
4.000.000	China Development Bank	2,65 %	24.02.2027	553.629	0,40
5.500.000	China Development Bank	4,04 %	10.04.2027	797.576	0,58
4.600.000	China Development Bank	2,69 %	16.06.2027	637.131	0,46
2.500.000	China Development Bank	3,39 %	10.07.2027	354.706	0,26
2.500.000	China Development Bank	4,24 %	24.08.2027	366.227	0,27
2.600.000	China Development Bank	3,40 %	08.01.2028	369.754	0,27
2.000.000	China Development Bank	2,73 %	11.01.2028	277.706	0,20

L&G China CNY Bond UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
China (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
4.900.000	China Development Bank	4,88 %	09.02.2028	739.984	0,54
5.300.000	China Development Bank	4,04 %	06.07.2028	777.307	0,56
2.300.000	China Development Bank	3,09 %	09.08.2028	322.783	0,23
5.100.000	China Development Bank	3,48 %	08.01.2029	730.024	0,53
800.000	China Development Bank	2,99 %	01.03.2029	111.723	0,08
4.700.000	China Development Bank	3,65 %	21.05.2029	679.225	0,49
3.950.000	China Development Bank	3,45 %	20.09.2029	565.601	0,41
4.300.000	China Development Bank	3,07 %	10.03.2030	602.928	0,44
5.600.000	China Development Bank	3,09 %	18.06.2030	786.512	0,57
6.000.000	China Development Bank	3,70 %	20.10.2030	875.548	0,63
5.200.000	China Development Bank	3,66 %	01.03.2031	757.322	0,55
6.000.000	China Development Bank	3,41 %	07.06.2031	860.039	0,62
6.500.000	China Development Bank	3,12 %	13.09.2031	911.881	0,66
6.000.000	China Development Bank	3,00 %	17.01.2032	834.088	0,60
6.900.000	China Development Bank	2,98 %	22.04.2032	957.708	0,69
4.000.000	China Development Bank	2,96 %	18.07.2032	554.383	0,40
5.100.000	China Development Bank	2,77 %	24.10.2032	696.550	0,50
4.500.000	China Development Bank	3,02 %	06.03.2033	629.597	0,46
2.000.000	China Development Bank	2,82 %	22.05.2033	276.394	0,20
2.800.000	China Government Bond	3,20 %	16.03.2024	388.975	0,28
4.300.000	China Government Bond	4,42 %	20.03.2024	604.677	0,44
12.500.000	China Government Bond	2,84 %	08.04.2024	1.733.371	1,25
11.400.000	China Government Bond	3,19 %	11.04.2024	1.585.136	1,15
5.000.000	China Government Bond	4,00 %	19.06.2024	704.462	0,51
4.300.000	China Government Bond	3,57 %	22.06.2024	601.589	0,44
13.300.000	China Government Bond	2,47 %	02.09.2024	1.840.222	1,33
3.000.000	China Government Bond	4,13 %	18.09.2024	425.331	0,31
4.050.000	China Government Bond	3,69 %	21.09.2024	570.373	0,41
10.340.000	China Government Bond	2,94 %	17.10.2024	1.440.809	1,04
1.500.000	China Government Bond	3,90 %	21.12.2024	212.916	0,15
10.600.000	China Government Bond	2,26 %	24.02.2025	1.461.836	1,06

L&G China CNY Bond UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
China (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
2.800.000	China Government Bond	3,77 %	08.03.2025	398.046	0,29
15.300.000	China Government Bond	1,99 %	09.04.2025	2.100.398	1,52
8.300.000	China Government Bond	2,24 %	25.05.2025	1.144.108	0,83
5.800.000	China Government Bond	3,61 %	07.06.2025	824.370	0,60
6.750.000	China Government Bond	2,18 %	25.08.2025	929.009	0,67
4.600.000	China Government Bond	3,60 %	06.09.2025	655.037	0,47
6.000.000	China Government Bond	2,99 %	15.10.2025	841.004	0,61
15.720.000	China Government Bond	3,02 %	22.10.2025	2.205.553	1,60
1.300.000	China Government Bond	2,28 %	25.11.2025	179.149	0,13
13.400.000	China Government Bond	3,22 %	06.12.2025	1.890.806	1,37
3.600.000	China Government Bond	2,85 %	28.01.2026	503.655	0,36
7.400.000	China Government Bond	2,46 %	15.02.2026	1.024.500	0,74
12.050.000	China Government Bond	3,03 %	11.03.2026	1.694.902	1,23
4.300.000	China Government Bond	2,90 %	05.05.2026	602.929	0,44
12.700.000	China Government Bond	3,25 %	06.06.2026	1.800.713	1,30
3.500.000	China Government Bond	2,74 %	04.08.2026	487.840	0,35
15.200.000	China Government Bond	2,69 %	12.08.2026	2.117.005	1,53
2.800.000	China Government Bond	2,70 %	03.11.2026	390.081	0,28
11.600.000	China Government Bond	3,12 %	05.12.2026	1.639.972	1,19
8.000.000	China Government Bond	2,37 %	20.01.2027	1.101.380	0,80
3.700.000	China Government Bond	3,40 %	09.02.2027	529.853	0,38
7.700.000	China Government Bond	2,48 %	15.04.2027	1.063.642	0,77
4.000.000	China Government Bond	3,52 %	04.05.2027	576.351	0,42
14.000.000	China Government Bond	2,85 %	04.06.2027	1.961.126	1,42
8.900.000	China Government Bond	2,50 %	25.07.2027	1.230.054	0,89
6.000.000	China Government Bond	3,59 %	03.08.2027	872.752	0,63
7.500.000	China Government Bond	2,44 %	15.10.2027	1.033.918	0,75
2.700.000	China Government Bond	3,82 %	02.11.2027	397.404	0,29
16.000.000	China Government Bond	3,28 %	03.12.2027	2.289.572	1,66
9.000.000	China Government Bond	2,64 %	15.01.2028	1.250.475	0,91
4.000.000	China Government Bond	3,85 %	01.02.2028	590.401	0,43

L&G China CNY Bond UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
China (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
4.000.000	China Government Bond	2,62 %	15.04.2028	556.011	0,40
12.300.000	China Government Bond	3,01 %	13.05.2028	1.739.046	1,26
6.500.000	China Government Bond	3,69 %	17.05.2028	953.157	0,69
7.000.000	China Government Bond	3,54 %	16.08.2028	1.019.619	0,74
10.000.000	China Government Bond	2,91 %	14.10.2028	1.405.601	1,02
8.050.000	China Government Bond	3,25 %	22.11.2028	1.154.631	0,84
7.900.000	China Government Bond	2,80 %	24.03.2029	1.102.621	0,80
12.000.000	China Government Bond	3,29 %	23.05.2029	1.725.760	1,25
9.600.000	China Government Bond	2,75 %	15.06.2029	1.333.805	0,97
9.750.000	China Government Bond	2,62 %	25.09.2029	1.343.297	0,97
11.700.000	China Government Bond	3,13 %	21.11.2029	1.665.115	1,21
8.300.000	China Government Bond	2,79 %	15.12.2029	1.153.738	0,84
18.760.000	China Government Bond	2,68 %	21.05.2030	2.590.423	1,88
14.450.000	China Government Bond	3,27 %	19.11.2030	2.085.563	1,51
11.300.000	China Government Bond	3,02 %	27.05.2031	1.596.178	1,16
9.000.000	China Government Bond	2,89 %	18.11.2031	1.257.288	0,91
9.900.000	China Government Bond	2,75 %	17.02.2032	1.367.628	0,99
7.900.000	China Government Bond	2,76 %	15.05.2032	1.091.960	0,79
10.300.000	China Government Bond	2,69 %	15.08.2032	1.415.391	1,02
8.500.000	China Government Bond	2,60 %	01.09.2032	1.159.460	0,84
8.900.000	China Government Bond	2,80 %	15.11.2032	1.234.814	0,89
9.900.000	China Government Bond	2,88 %	25.02.2033	1.385.651	1,00
4.700.000	China Government Bond	2,67 %	25.05.2033	648.913	0,47
5.100.000	China Government Bond	2,80 %	25.03.2030	709.750	0,51
2.500.000	Export-Import Bank of China/The	3,28 %	11.02.2024	346.426	0,25
2.300.000	Export-Import Bank of China/The	3,14 %	02.04.2024	319.009	0,23
4.190.000	Export-Import Bank of China/The	2,93 %	02.03.2025	582.790	0,42
2.750.000	Export-Import Bank of China/The	4,29 %	07.04.2025	391.277	0,28
3.100.000	Export-Import Bank of China/The	3,87 %	14.09.2025	440.322	0,32
2.800.000	Export-Import Bank of China/The	3,43 %	23.10.2025	394.433	0,29
1.900.000	Export-Import Bank of China/The	3,33 %	22.02.2026	267.642	0,19

L&G China CNY Bond UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
China (30. Juni 2022: 98,66 %) (Fortsetzung)					
3.600.000	Export-Import Bank of China/The	3,22 %	14.05.2026	506.640	0,37
2.100.000	Export-Import Bank of China/The	3,18 %	05.09.2026	295.418	0,21
2.200.000	Export-Import Bank of China/The	2,61 %	27.01.2027	303.717	0,22
750.000	Export-Import Bank of China/The	3,26 %	24.02.2027	105.810	0,08
1.500.000	Export-Import Bank of China/The	4,11 %	20.03.2027	217.853	0,16
3.000.000	Export-Import Bank of China/The	2,82 %	17.06.2027	416.734	0,30
2.500.000	Export-Import Bank of China/The	2,87 %	06.02.2028	348.040	0,25
2.270.000	Export-Import Bank of China/The	4,89 %	26.03.2028	343.924	0,25
3.300.000	Export-Import Bank of China/The	3,86 %	20.05.2029	482.094	0,35
3.670.000	Export-Import Bank of China/The	3,23 %	23.03.2030	519.143	0,38
2.100.000	Export-Import Bank of China/The	3,74 %	16.11.2030	307.390	0,22
5.800.000	Export-Import Bank of China/The	3,38 %	16.07.2031	828.981	0,60
4.100.000	Export-Import Bank of China/The	3,18 %	11.03.2032	577.332	0,42
2.300.000	Export-Import Bank of China/The	2,90 %	19.08.2032	316.833	0,23
2.100.000	Export-Import Bank of China/The	3,10 %	13.02.2033	294.123	0,21
Total China				136.416.652	98,76
Total Government Bond				136.416.652	98,76
Gesamtanlagen					
Staatsanleihe				136.416.652	98,76
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				1.713.266	1,24
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen				138.129.918	100,00
Analyse des Gesamtvermögens					
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					97,68
Sonstige Vermögenswerte					2,32
					100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

*Mit Wirkung vom 28. November 2022 wurde der Name des Fonds von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF geändert.

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %)					
Australien (30. Juni 2022: 2,55 %)					
225.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' FRN	2,57 %	25.11.2035	171.558	0,14
50.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	2,85 %	18.05.2026	46.838	0,04
80.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	2,55 %	14.03.2027	73.238	0,06
80.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	3,90 %	16.03.2028	76.342	0,06
225.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	3,31 %	11.03.2041	156.653	0,13
25.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	3,90 %	12.07.2047	21.685	0,02
165.000	Macquarie Bank Ltd '144A'	2,30 %	22.01.2025	156.584	0,13
200.000	Macquarie Bank Ltd '144A' FRN	3,05 %	03.03.2036	151.630	0,12
100.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN	5,03 %	15.01.2030	97.620	0,08
250.000	National Australia Bank Ltd '144A'	2,33 %	21.08.2030	195.663	0,16
250.000	National Australia Bank Ltd/New York	3,38 %	14.01.2026	239.051	0,19
150.000	Newcrest Finance Pty Ltd '144A'	3,25 %	13.05.2030	132.300	0,11
350.000	Santos Finance Ltd 'EMTN'	5,25 %	13.03.2029	330.573	0,27
20.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A'	3,75 %	23.03.2027	18.680	0,01
300.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A'	4,38 %	28.05.2030	280.765	0,23
157.000	Suncorp-Metway Ltd '144A'	3,30 %	15.04.2024	153.684	0,13
100.000	Telstra Corp Ltd '144A'	3,13 %	07.04.2025	96.116	0,08
50.000	Transurban Finance Co Pty Ltd '144A'	3,38 %	22.03.2027	46.455	0,04
100.000	Westpac Banking Corp	3,30 %	26.02.2024	98.432	0,08
100.000	Westpac Banking Corp	1,15 %	03.06.2026	89.140	0,07
30.000	Westpac Banking Corp	2,65 %	16.01.2030	26.486	0,02
100.000	Westpac Banking Corp	2,15 %	03.06.2031	83.457	0,07
200.000	Westpac Banking Corp FRN	2,89 %	04.02.2030	186.406	0,15
154.000	Westpac Banking Corp 'GMTN' FRN	4,32 %	23.11.2031	142.931	0,12
100.000	Woodside Finance Ltd '144A'	3,65 %	05.03.2025	96.296	0,08
Australien insgesamt				3.168.583	2,59
Kanada (30. Juni 2022: 3,86 %)					
100.000	Alimentation Couche-Tard Inc '144A'	2,95 %	25.01.2030	85.839	0,07
100.000	Bank of Montreal	3,30 %	05.02.2024	98.481	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Kanada (30. Juni 2022: 3,86 %) (Fortsetzung)					
70.000	Bank of Montreal FRN	4,34 %	05.10.2028	69.226	0,06
80.000	Bank of Montreal FRN	3,09 %	10.01.2037	63.015	0,05
100.000	Bank of Montreal 'MTN'	1,85 %	01.05.2025	93.409	0,08
100.000	Bank of Nova Scotia/The	3,40 %	11.02.2024	98.606	0,08
100.000	Bank of Nova Scotia/The	0,70 %	15.04.2024	96.143	0,08
100.000	Bank of Nova Scotia/The	5,25 %	06.12.2024	99.176	0,08
100.000	Bank of Nova Scotia/The	2,70 %	03.08.2026	92.375	0,08
85.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The	5,10 %	11.05.2033	84.065	0,07
50.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The	4,30 %	29.07.2049	42.156	0,03
50.000	Brookfield Finance Inc	4,25 %	02.06.2026	47.930	0,04
100.000	Canadian Imperial Bank of Commerce	0,50 %	14.12.2023	97.658	0,08
125.000	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,25 %	28.01.2025	118.399	0,10
100.000	Canadian National Railway Co	2,75 %	01.03.2026	94.164	0,08
20.000	Canadian National Railway Co	3,65 %	03.02.2048	16.324	0,01
25.000	Canadian National Railway Co	2,45 %	01.05.2050	15.966	0,01
100.000	Canadian Pacific Railway Co	2,90 %	01.02.2025	95.854	0,08
20.000	Canadian Pacific Railway Co	4,00 %	01.06.2028	19.146	0,02
100.000	Canadian Pacific Railway Co	2,05 %	05.03.2030	84.177	0,07
50.000	Canadian Pacific Railway Co	3,10 %	02.12.2051	35.506	0,03
50.000	Enbridge Inc	2,50 %	15.01.2025	47.575	0,04
40.000	Enbridge Inc	3,13 %	15.11.2029	35.287	0,03
50.000	Enbridge Inc	5,50 %	01.12.2046	47.618	0,04
150.000	Enbridge Inc	3,40 %	01.08.2051	104.268	0,08
100.000	Enbridge Inc FRN	7,38 %	15.01.2083	99.062	0,08
100.000	Manulife Financial Corp	2,48 %	19.05.2027	91.655	0,07
75.000	Manulife Financial Corp	5,38 %	04.03.2046	73.992	0,06
200.000	Nutrien Ltd	2,95 %	13.05.2030	174.176	0,14
200.000	Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust '144A'	4,13 %	01.02.2029	181.671	0,15
175.000	Rogers Communications Inc	4,35 %	01.05.2049	137.849	0,11

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Kanada (30. Juni 2022: 3,86 %) (Fortsetzung)					
10.000	Rogers Communications Inc '144A'	2,95 %	15.03.2025	9.497	0,01
100.000	Rogers Communications Inc '144A'	4,50 %	15.03.2042	83.352	0,07
100.000	Royal Bank of Canada	1,20 %	27.04.2026	89.059	0,07
100.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	2,55 %	16.07.2024	96.746	0,08
50.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	2,25 %	01.11.2024	47.793	0,04
75.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	4,65 %	27.01.2026	72.964	0,06
80.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	4,24 %	03.08.2027	77.039	0,06
50.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	2,30 %	03.11.2031	40.578	0,03
175.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	5,00 %	01.02.2033	171.652	0,14
50.000	TELUS Corp	3,40 %	13.05.2032	42.861	0,03
100.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'	2,65 %	12.06.2024	96.986	0,08
100.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'	1,15 %	12.06.2025	92.044	0,08
75.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'	0,75 %	11.09.2025	67.882	0,06
50.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'	4,69 %	15.09.2027	49.036	0,04
69.000	TransCanada PipeLines Ltd	4,10 %	15.04.2030	64.074	0,05
50.000	TransCanada PipeLines Ltd	5,00 %	16.10.2043	44.894	0,04
20.000	Transcanada Trust FRN	5,60 %	07.03.2082	16.775	0,01
Kanada insgesamt				3.704.000	3,03
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 0,25 %)					
100.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A'	4,25 %	15.04.2026	93.234	0,08
100.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A'	3,25 %	15.02.2027	89.452	0,07
79.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A'	2,53 %	18.11.2027	66.730	0,06
28.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A'	5,50 %	15.02.2024	27.708	0,02
Cayman-Inseln insgesamt				277.124	0,23
Finnland (30. Juni 2022: – %)					
200.000	Nordea Bank Abp '144A'	5,38 %	22.09.2027	196.953	0,16
Finnland insgesamt				196.953	0,16

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Frankreich (30. Juni 2022: 2,93 %)					
200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A'	3,75 %	20.07.2023	199.828	0,17
400.000	BNP Paribas SA '144A'	4,40 %	14.08.2028	377.772	0,31
300.000	BNP Paribas SA '144A' FRN	5,34 %	12.06.2029	296.354	0,24
200.000	BPCE SA '144A'	5,15 %	21.07.2024	195.797	0,16
250.000	BPCE SA '144A'	1,00 %	20.01.2026	222.952	0,18
250.000	BPCE SA '144A' FRN	5,75 %	19.07.2033	243.198	0,20
200.000	Credit Agricole SA '144A'	4,38 %	17.03.2025	193.032	0,16
425.000	Electricite de France SA '144A'	3,63 %	13.10.2025	407.597	0,34
230.000	La Mondiale SAM FRN	5,88 %	26.01.2047	221.088	0,18
270.000	Orange SA	9,00 %	01.03.2031	332.111	0,27
150.000	Pernod Ricard SA '144A'	3,25 %	08.06.2026	143.859	0,12
50.000	Sanofi	3,63 %	19.06.2028	48.230	0,04
200.000	Societe Generale SA '144A'	4,25 %	14.09.2023	199.114	0,16
200.000	Societe Generale SA '144A'	4,25 %	19.08.2026	185.008	0,15
200.000	Societe Generale SA '144A' FRN	6,22 %	15.06.2033	185.817	0,15
Frankreich insgesamt				3.451.757	2,83
Deutschland (30. Juni 2022: 0,22 %)					
75.000	Deutsche Bank AG/London	3,70 %	30.05.2024	73.034	0,06
150.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN	3,96 %	26.11.2025	143.168	0,12
150.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN	2,55 %	07.01.2028	130.034	0,10
200.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN	3,73 %	14.01.2032	151.163	0,12
300.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN	7,08 %	10.02.2034	276.970	0,23
Deutschland insgesamt				774.369	0,63
International (30. Juni 2022: 0,45 %)					
99.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd	3,88 %	15.01.2027	94.402	0,08
100.000	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A'	4,75 %	20.10.2028	97.305	0,08
100.000	NXP BV / NXP Funding LLC	5,35 %	01.03.2026	99.398	0,08
121.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc	4,30 %	18.06.2029	114.006	0,09
International insgesamt				405.111	0,33

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Irland (30. Juni 2022: 0,78 %)					
150.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	4,88 %	16.01.2024	148.973	0,12
150.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	2,88 %	14.08.2024	144.189	0,12
150.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	2,45 %	29.10.2026	134.006	0,11
200.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	3,88 %	23.01.2028	183.957	0,15
200.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	3,30 %	30.01.2032	163.220	0,13
100.000	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA	1,75 %	15.09.2030	81.057	0,07
16.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	2,88 %	23.09.2023	15.903	0,01
200.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 'EMTN' FRN	3,00 %	19.04.2051	156.750	0,13
Irland insgesamt				1.028.055	0,84
Japan (30. Juni 2022: 2,94 %)					
200.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	2,80 %	18.07.2024	193.514	0,16
100.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	3,29 %	25.07.2027	92.730	0,08
31.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	4,29 %	26.07.2038	27.640	0,02
10.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	4,15 %	07.03.2039	8.881	0,01
173.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN	6,13 %	26.07.2023	173.050	0,14
250.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN	5,44 %	22.02.2034	249.503	0,20
200.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN	5,41 %	19.04.2034	198.209	0,16
200.000	Mizuho Financial Group Inc '144A'	3,48 %	12.04.2026	189.554	0,15
200.000	Mizuho Financial Group Inc FRN	2,23 %	25.05.2026	185.839	0,15
200.000	Mizuho Financial Group Inc FRN	5,75 %	27.05.2034	201.295	0,16
200.000	Nippon Life Insurance Co '144A' FRN	4,70 %	20.01.2046	192.000	0,16
200.000	Nomura Holdings Inc	2,17 %	14.07.2028	169.214	0,14
200.000	NTT Finance Corp '144A'	1,16 %	03.04.2026	179.127	0,15
75.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3,94 %	16.10.2023	74.618	0,06
100.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3,78 %	09.03.2026	95.448	0,08
100.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3,01 %	19.10.2026	92.204	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Japan (30. Juni 2022: 2,94 %) (Fortsetzung)					
157.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3,45 %	11.01.2027	147.239	0,12
157.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3,20 %	17.09.2029	137.503	0,11
75.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	2,14 %	23.09.2030	60.064	0,05
300.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd '144A'	2,55 %	10.03.2025	283.889	0,23
225.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	3,03 %	09.07.2040	170.034	0,14
Japan insgesamt				3.121.555	2,55
Luxemburg (30. Juni 2022: 0,28 %)					
200.000	Aroundtown SA 'EMTN'	5,38 %	21.03.2029	147.984	0,12
50.000	DH Europe Finance II Sarl	3,25 %	15.11.2039	40.843	0,04
50.000	Schlumberger Investment SA	3,65 %	01.12.2023	49.581	0,04
72.000	Schlumberger Investment SA	2,65 %	26.06.2030	63.037	0,05
50.000	Schlumberger Investment SA	4,85 %	15.05.2033	49.121	0,04
50.000	Trane Technologies Luxembourg Finance SA	3,80 %	21.03.2029	46.668	0,04
Luxemburg insgesamt				397.234	0,33
Niederlande (30. Juni 2022: 1,58 %)					
200.000	ABN AMRO Bank NV '144A'	4,80 %	18.04.2026	191.121	0,16
250.000	Cooperatieve Rabobank UA '144A'	2,63 %	22.07.2024	241.418	0,20
51.000	Cooperatieve Rabobank UA 'BKNT'	5,25 %	24.05.2041	53.117	0,04
115.000	Deutsche Telekom International Finance BV	8,75 %	15.06.2030	137.190	0,11
136.000	Heineken NV '144A'	3,50 %	29.01.2028	129.071	0,11
200.000	ING Groep NV	3,95 %	29.03.2027	189.593	0,16
30.000	Koninklijke Philips NV	5,00 %	15.03.2042	27.417	0,02
50.000	LYB International Finance BV	5,25 %	15.07.2043	45.563	0,04
50.000	LyondellBasell Industries NV	4,63 %	26.02.2055	40.604	0,03
250.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A'	3,40 %	16.03.2027	237.171	0,19
Niederlande insgesamt				1.292.265	1,06

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Neuseeland (30. Juni 2022: – %)					
200.000	ANZ Bank New Zealand Ltd '144A' FRN	5,55 %	11.08.2032	196.239	0,16
Neuseeland insgesamt				196.239	0,16
Norwegen (30. Juni 2022: 0,39 %)					
150.000	Aker BP ASA '144A'	6,00 %	13.06.2033	150.312	0,12
60.000	Equinor ASA	3,70 %	01.03.2024	59.104	0,05
81.000	Equinor ASA	3,63 %	10.09.2028	77.227	0,06
158.000	Equinor ASA	3,70 %	06.04.2050	127.966	0,11
150.000	Yara International ASA '144A'	3,15 %	04.06.2030	126.659	0,10
Norwegen insgesamt				541.268	0,44
Singapur (30. Juni 2022: – %)					
300.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd	4,45 %	19.05.2026	296.306	0,24
100.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd	5,30 %	19.05.2053	103.947	0,09
100.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd	5,34 %	19.05.2063	101.258	0,08
Singapur insgesamt				501.511	0,41
Spanien (30. Juni 2022: 0,77 %)					
200.000	Banco Santander SA	2,75 %	28.05.2025	187.990	0,15
200.000	Banco Santander SA	4,25 %	11.04.2027	189.263	0,16
200.000	Banco Santander SA	2,75 %	03.12.2030	156.599	0,13
200.000	Banco Santander SA FRN	5,74 %	30.06.2024	199.009	0,16
10.000	Telefonica Emisiones SA	7,05 %	20.06.2036	10.913	0,01
150.000	Telefonica Emisiones SA	5,21 %	08.03.2047	130.004	0,11
Spanien insgesamt				873.778	0,72
Schweden (30. Juni 2022: – %)					
200.000	Swedbank AB '144A'	5,47 %	15.06.2026	198.427	0,16
Schweden insgesamt				198.427	0,16

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Schweiz (30. Juni 2022: 1,15 %)					
200.000	UBS AG/London '144A'	0,70 %	09.08.2024	188.696	0,15
500.000	UBS Group AG	3,75 %	26.03.2025	478.766	0,39
200.000	UBS Group AG '144A'	4,13 %	15.04.2026	190.357	0,16
225.000	UBS Group AG '144A' FRN	2,10 %	11.02.2032	170.687	0,14
Schweiz insgesamt				1.028.506	0,84
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 4,58 %)					
100.000	AstraZeneca Plc	3,38 %	16.11.2025	96.058	0,08
100.000	AstraZeneca Plc	0,70 %	08.04.2026	89.256	0,07
50.000	AstraZeneca Plc	6,45 %	15.09.2037	57.355	0,05
100.000	AstraZeneca Plc	2,13 %	06.08.2050	62.453	0,05
200.000	Barclays Bank Plc 'BKNT'	3,75 %	15.05.2024	195.694	0,16
200.000	Barclays Plc	5,20 %	12.05.2026	192.567	0,16
200.000	Barclays Plc	4,34 %	10.01.2028	188.030	0,15
200.000	Barclays Plc FRN	2,67 %	10.03.2032	157.497	0,13
200.000	British Telecommunications Plc	5,13 %	04.12.2028	196.419	0,16
300.000	British Telecommunications Plc '144A'	3,25 %	08.11.2029	262.601	0,22
200.000	Diageo Capital Plc	2,38 %	24.10.2029	172.864	0,14
15.000	HSBC Holdings Plc	6,10 %	14.01.2042	15.845	0,01
200.000	HSBC Holdings Plc FRN	3,80 %	11.03.2025	196.643	0,16
400.000	HSBC Holdings Plc FRN	1,65 %	18.04.2026	368.760	0,30
400.000	HSBC Holdings Plc FRN	4,58 %	19.06.2029	376.598	0,31
200.000	HSBC Holdings Plc FRN	3,97 %	22.05.2030	179.502	0,15
200.000	HSBC Holdings Plc FRN	8,11 %	03.11.2033	221.955	0,18
400.000	HSBC Holdings Plc FRN	6,25 %	09.03.2034	409.220	0,34
200.000	Lloyds Banking Group Plc	4,05 %	16.08.2023	199.533	0,16
200.000	Lloyds Banking Group Plc	4,45 %	08.05.2025	193.633	0,16
200.000	Lloyds Banking Group Plc	4,65 %	24.03.2026	190.354	0,16
200.000	Lloyds Banking Group Plc FRN	3,57 %	07.11.2028	181.488	0,15
200.000	Nationwide Building Society '144A' FRN	4,36 %	01.08.2024	199.580	0,16

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 4,58 %) (Fortsetzung)					
200.000	Nationwide Building Society '144A' FRN	4,30 %	08.03.2029	185.937	0,15
200.000	NatWest Group Plc	4,80 %	05.04.2026	194.074	0,16
200.000	NatWest Group Plc FRN	6,02 %	02.03.2034	201.277	0,16
200.000	NatWest Group Plc FRN	3,03 %	28.11.2035	153.343	0,13
400.000	Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN'	5,38 %	06.07.2027	384.250	0,31
100.000	Royalty Pharma Plc	0,75 %	02.09.2023	99.099	0,08
50.000	Royalty Pharma Plc	1,75 %	02.09.2027	42.978	0,04
200.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN	4,80 %	15.11.2024	198.636	0,16
50.000	Vodafone Group Plc	3,75 %	16.01.2024	49.423	0,04
200.000	Vodafone Group Plc	4,38 %	30.05.2028	195.795	0,16
40.000	Vodafone Group Plc	7,88 %	15.02.2030	45.983	0,04
125.000	Vodafone Group Plc	4,88 %	19.06.2049	111.058	0,09
20.000	Vodafone Group Plc	4,25 %	17.09.2050	16.093	0,01
200.000	WPP Finance 2010	3,75 %	19.09.2024	193.156	0,16
Vereinigtes Königreich insgesamt				6.475.007	5,30
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %)					
50.000	3M Co	2,00 %	14.02.2025	47.170	0,04
100.000	3M Co	2,88 %	15.10.2027	91.584	0,07
50.000	3M Co	3,25 %	26.08.2049	36.342	0,03
75.000	7-Eleven Inc '144A'	0,80 %	10.02.2024	72.701	0,06
50.000	Abbott Laboratories	3,75 %	30.11.2026	48.756	0,04
40.000	Abbott Laboratories	4,75 %	30.11.2036	40.159	0,03
25.000	Abbott Laboratories	5,30 %	27.05.2040	26.198	0,02
53.000	Abbott Laboratories	4,90 %	30.11.2046	53.471	0,04
25.000	AbbVie Inc	3,75 %	14.11.2023	24.827	0,02
60.000	AbbVie Inc	3,85 %	15.06.2024	59.026	0,05
100.000	AbbVie Inc	2,60 %	21.11.2024	95.999	0,08
50.000	AbbVie Inc	3,60 %	14.05.2025	48.373	0,04
40.000	AbbVie Inc	3,20 %	14.05.2026	37.896	0,03

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
100.000	AbbVie Inc	2,95 %	21.11.2026	93.499	0,08
40.000	AbbVie Inc	4,30 %	14.05.2036	36.699	0,03
50.000	AbbVie Inc	4,05 %	21.11.2039	43.713	0,04
35.000	AbbVie Inc	4,40 %	06.11.2042	31.287	0,03
150.000	AbbVie Inc	4,70 %	14.05.2045	137.081	0,11
45.000	AbbVie Inc	4,45 %	14.05.2046	39.844	0,03
40.000	AbbVie Inc	4,25 %	21.11.2049	34.639	0,03
100.000	Adobe Inc	3,25 %	01.02.2025	97.082	0,08
50.000	Aetna Inc	6,63 %	15.06.2036	55.135	0,04
50.000	Aetna Inc	4,13 %	15.11.2042	41.264	0,03
15.000	Aflac Inc	4,75 %	15.01.2049	13.952	0,01
200.000	Air Lease Corp	3,63 %	01.12.2027	182.504	0,15
50.000	Air Lease Corp 'GMTN'	3,75 %	01.06.2026	47.192	0,04
50.000	Air Lease Corp 'MTN'	4,25 %	01.02.2024	49.381	0,04
50.000	Air Lease Corp 'MTN'	2,88 %	15.01.2026	46.269	0,04
40.000	Air Products and Chemicals Inc	1,85 %	15.05.2027	35.980	0,03
30.000	Air Products and Chemicals Inc	2,80 %	15.05.2050	21.534	0,02
151.000	Alexandria Real Estate Equities Inc	4,90 %	15.12.2030	146.111	0,12
100.000	Alexandria Real Estate Equities Inc	3,38 %	15.08.2031	85.802	0,07
25.000	Alexandria Real Estate Equities Inc	2,00 %	18.05.2032	18.917	0,02
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc	1,88 %	01.02.2033	7.314	0,01
20.000	Allstate Corp/The	5,55 %	09.05.2035	20.233	0,02
50.000	Allstate Corp/The	4,20 %	15.12.2046	40.887	0,03
100.000	Ally Financial Inc	8,00 %	01.11.2031	103.974	0,08
50.000	Alphabet Inc	2,00 %	15.08.2026	46.236	0,04
50.000	Alphabet Inc	2,05 %	15.08.2050	31.222	0,03
50.000	Amcor Finance USA Inc	3,63 %	28.04.2026	47.285	0,04
200.000	American Assets Trust LP	3,38 %	01.02.2031	156.791	0,13
112.000	American Equity Investment Life Holding Co	5,00 %	15.06.2027	108.015	0,09
100.000	American Express Co	3,70 %	03.08.2023	99.847	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
120.000	American Express Co	4,90 %	13.02.2026	118.856	0,10
100.000	American Express Credit Corp 'MTN'	3,30 %	03.05.2027	93.491	0,08
156.000	American Honda Finance Corp 'MTN'	2,90 %	16.02.2024	153.381	0,13
200.000	American Honda Finance Corp 'MTN'	2,00 %	24.03.2028	175.048	0,14
40.000	American Honda Finance Corp 'MTN'	1,80 %	13.01.2031	32.414	0,03
100.000	American International Group Inc	3,40 %	30.06.2030	88.592	0,07
61.000	American International Group Inc	4,50 %	16.07.2044	52.516	0,04
75.000	American International Group Inc	4,75 %	01.04.2048	66.854	0,05
125.000	American Tower Corp	2,95 %	15.01.2025	119.555	0,10
50.000	American Tower Corp	3,38 %	15.10.2026	46.690	0,04
100.000	American Tower Corp	1,50 %	31.01.2028	83.871	0,07
40.000	American Tower Corp	2,70 %	15.04.2031	33.266	0,03
80.000	American Tower Corp	5,65 %	15.03.2033	80.848	0,07
75.000	American Tower Corp	5,55 %	15.07.2033	75.246	0,06
50.000	American Tower Corp	3,10 %	15.06.2050	32.706	0,03
167.000	American Water Capital Corp	3,75 %	01.09.2047	131.991	0,11
100.000	American Water Capital Corp	3,45 %	01.05.2050	75.538	0,06
75.000	Ameriprise Financial Inc	5,15 %	15.05.2033	74.207	0,06
50.000	AmerisourceBergen Corp	2,80 %	15.05.2030	43.368	0,04
500.000	AmFam Holdings Inc '144A'	2,81 %	11.03.2031	369.241	0,30
40.000	Amgen Inc	3,63 %	22.05.2024	39.228	0,03
50.000	Amgen Inc	3,13 %	01.05.2025	47.936	0,04
50.000	Amgen Inc	5,51 %	02.03.2026	49.861	0,04
40.000	Amgen Inc	2,20 %	21.02.2027	36.374	0,03
50.000	Amgen Inc	1,65 %	15.08.2028	42.857	0,03
150.000	Amgen Inc	4,05 %	18.08.2029	141.759	0,12
40.000	Amgen Inc	2,30 %	25.02.2031	33.259	0,03
50.000	Amgen Inc	5,25 %	02.03.2033	50.157	0,04
100.000	Amgen Inc	3,15 %	21.02.2040	76.507	0,06
100.000	Amgen Inc	4,95 %	01.10.2041	92.652	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
50.000	Amgen Inc	3,38 %	21.02.2050	36.216	0,03
150.000	Amgen Inc	4,66 %	15.06.2051	135.057	0,11
50.000	Amgen Inc	3,00 %	15.01.2052	33.276	0,03
50.000	Amgen Inc	4,88 %	01.03.2053	46.027	0,04
50.000	Amgen Inc	5,65 %	02.03.2053	50.886	0,04
25.000	Amgen Inc	2,77 %	01.09.2053	15.663	0,01
75.000	Amgen Inc	4,40 %	22.02.2062	61.702	0,05
50.000	Amgen Inc	5,75 %	02.03.2063	51.027	0,04
35.000	Analog Devices Inc	3,50 %	05.12.2026	33.599	0,03
100.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	3,65 %	01.02.2026	96.805	0,08
50.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	4,70 %	01.02.2036	48.639	0,04
175.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	4,90 %	01.02.2046	167.854	0,14
125.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	3,50 %	01.06.2030	116.376	0,09
150.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	5,45 %	23.01.2039	154.999	0,13
80.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	4,60 %	15.04.2048	74.703	0,06
30.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	5,55 %	23.01.2049	31.621	0,03
60.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	5,80 %	23.01.2059	65.196	0,05
50.000	Aon Corp	3,75 %	02.05.2029	46.384	0,04
50.000	Apollo Management Holdings LP '144A'	4,00 %	30.05.2024	49.019	0,04
300.000	Apollo Management Holdings LP '144A'	4,40 %	27.05.2026	286.105	0,23
100.000	Apple Inc	3,45 %	06.05.2024	98.451	0,08
100.000	Apple Inc	2,75 %	13.01.2025	96.411	0,08
100.000	Apple Inc	1,13 %	11.05.2025	93.261	0,08
100.000	Apple Inc	2,05 %	11.09.2026	92.184	0,08
100.000	Apple Inc	3,20 %	11.05.2027	95.553	0,08
25.000	Apple Inc	1,20 %	08.02.2028	21.677	0,02
100.000	Apple Inc	2,20 %	11.09.2029	87.799	0,07
50.000	Apple Inc	4,15 %	10.05.2030	49.224	0,04
100.000	Apple Inc	3,45 %	09.02.2045	84.266	0,07
117.000	Apple Inc	3,75 %	12.09.2047	101.829	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
40.000	Apple Inc	2,65 %	08.02.2051	27.669	0,02
275.000	Apple Inc	2,55 %	20.08.2060	181.590	0,15
170.000	Applied Materials Inc	5,10 %	01.10.2035	173.816	0,14
100.000	Archer-Daniels-Midland Co	3,25 %	27.03.2030	91.519	0,07
70.000	Ares Capital Corp	2,15 %	15.07.2026	60.724	0,05
35.000	Ares Capital Corp	2,88 %	15.06.2028	28.971	0,02
63.000	Arrow Electronics Inc	3,88 %	12.01.2028	58.189	0,05
150.000	Ascension Health	3,11 %	15.11.2039	117.097	0,10
100.000	AT&T Inc	5,54 %	20.02.2026	100.024	0,08
100.000	AT&T Inc	4,25 %	01.03.2027	97.146	0,08
100.000	AT&T Inc	2,30 %	01.06.2027	89.882	0,07
100.000	AT&T Inc	1,65 %	01.02.2028	85.991	0,07
200.000	AT&T Inc	4,35 %	01.03.2029	191.952	0,16
100.000	AT&T Inc	4,30 %	15.02.2030	94.835	0,08
75.000	AT&T Inc	2,75 %	01.06.2031	63.383	0,05
100.000	AT&T Inc	2,55 %	01.12.2033	78.362	0,06
200.000	AT&T Inc	5,40 %	15.02.2034	200.269	0,16
50.000	AT&T Inc	4,85 %	01.03.2039	46.027	0,04
151.000	AT&T Inc	3,50 %	01.06.2041	115.663	0,09
76.000	AT&T Inc	4,30 %	15.12.2042	64.806	0,05
125.000	AT&T Inc	3,10 %	01.02.2043	90.526	0,07
125.000	AT&T Inc	4,50 %	09.03.2048	106.301	0,09
100.000	AT&T Inc	3,65 %	01.06.2051	73.674	0,06
150.000	AT&T Inc	3,50 %	15.09.2053	106.718	0,09
50.000	AT&T Inc	3,55 %	15.09.2055	35.249	0,03
150.000	AT&T Inc	3,80 %	01.12.2057	109.300	0,09
350.000	AT&T Inc	3,85 %	01.06.2060	254.650	0,21
200.000	Athene Global Funding '144A'	1,00 %	16.04.2024	189.654	0,15
10.000	Atmos Energy Corp	3,00 %	15.06.2027	9.353	0,01
10.000	Atmos Energy Corp	1,50 %	15.01.2031	7.872	0,01

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
100.000	Autodesk Inc	3,50 %	15.06.2027	94.823	0,08
100.000	AutoZone Inc	1,65 %	15.01.2031	78.136	0,06
100.000	AvalonBay Communities Inc 'MTN'	2,45 %	15.01.2031	84.085	0,07
100.000	Avangrid Inc	3,15 %	01.12.2024	96.103	0,08
100.000	Aviation Capital Group LLC '144A'	1,95 %	30.01.2026	88.239	0,07
110.000	Aviation Capital Group LLC '144A'	1,95 %	20.09.2026	95.165	0,08
96.000	Avnet Inc	4,63 %	15.04.2026	92.653	0,08
40.000	Baker Hughes Holdings LLC	5,13 %	15.09.2040	38.664	0,03
200.000	Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc	2,06 %	15.12.2026	180.430	0,15
50.000	Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc	3,34 %	15.12.2027	46.341	0,04
50.000	Baltimore Gas and Electric Co	4,55 %	01.06.2052	44.573	0,04
97.000	Bank of America Corp	4,18 %	25.11.2027	92.159	0,08
40.000	Bank of America Corp FRN	5,77 %	22.04.2025	39.974	0,03
160.000	Bank of America Corp FRN	3,37 %	23.01.2026	153.643	0,13
760.000	Bank of America Corp FRN	6,20 %	10.11.2028	781.133	0,64
100.000	Bank of America Corp FRN	3,42 %	20.12.2028	91.534	0,07
250.000	Bank of America Corp FRN	2,65 %	11.03.2032	207.312	0,17
140.000	Bank of America Corp FRN	2,69 %	22.04.2032	116.198	0,09
60.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	2,97 %	04.02.2033	49.932	0,04
279.000	Bank of America Corp FRN	5,29 %	25.04.2034	276.812	0,23
50.000	Bank of America Corp FRN	2,48 %	21.09.2036	38.388	0,03
50.000	Bank of America Corp FRN	3,85 %	08.03.2037	42.804	0,03
75.000	Bank of America Corp FRN	3,31 %	22.04.2042	57.286	0,05
50.000	Bank of America Corp FRN	2,97 %	21.07.2052	34.219	0,03
225.000	Bank of America Corp 'GMTN' FRN	6,23 %	23.07.2024	225.047	0,18
100.000	Bank of America Corp 'MTN'	4,00 %	22.01.2025	97.305	0,08
100.000	Bank of America Corp 'MTN'	4,25 %	22.10.2026	96.149	0,08
100.000	Bank of America Corp 'MTN'	3,25 %	21.10.2027	93.167	0,08
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	3,86 %	23.07.2024	99.873	0,08
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	0,98 %	25.09.2025	93.772	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	2,46 %	22.10.2025	95.531	0,08
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	1,32 %	19.06.2026	91.590	0,07
165.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	1,20 %	24.10.2026	148.462	0,12
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	2,09 %	14.06.2029	85.463	0,07
157.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	3,97 %	07.02.2030	145.024	0,12
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	2,50 %	13.02.2031	83.706	0,07
340.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	4,08 %	23.04.2040	291.221	0,24
20.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	2,68 %	19.06.2041	14.115	0,01
28.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	4,44 %	20.01.2048	24.690	0,02
10.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	4,33 %	15.03.2050	8.622	0,01
135.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN	4,08 %	20.03.2051	112.007	0,09
150.000	Bank of New York Mellon Corp/The FRN	4,41 %	24.07.2026	146.746	0,12
75.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	2,20 %	16.08.2023	74.706	0,06
50.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	3,25 %	11.09.2024	48.572	0,04
100.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	1,60 %	24.04.2025	93.660	0,08
200.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	2,80 %	04.05.2026	186.920	0,15
154.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	3,25 %	16.05.2027	144.217	0,12
100.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	3,30 %	23.08.2029	89.237	0,07
200.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN' FRN	3,44 %	07.02.2028	188.319	0,15
115.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN' FRN	5,83 %	25.10.2033	119.473	0,10
100.000	Barrick North America Finance LLC	5,70 %	30.05.2041	101.376	0,08
50.000	Baxter International Inc	2,60 %	15.08.2026	45.904	0,04
100.000	Baxter International Inc	3,95 %	01.04.2030	92.066	0,08
50.000	Baxter International Inc	2,54 %	01.02.2032	40.624	0,03
50.000	Bayer US Finance II LLC '144A'	3,38 %	15.07.2024	48.492	0,04
200.000	Bayer US Finance II LLC '144A'	4,38 %	15.12.2028	189.638	0,15
20.000	Bayer US Finance II LLC '144A'	4,40 %	15.07.2044	15.882	0,01
25.000	Bayer US Finance II LLC '144A'	4,70 %	15.07.2064	19.999	0,02
50.000	Baylor Scott & White Holdings	2,84 %	15.11.2050	33.699	0,03
75.000	Becton Dickinson & Co	3,70 %	06.06.2027	71.334	0,06

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
80.000	Becton Dickinson & Co	4,69 %	13.02.2028	78.905	0,06
50.000	Becton Dickinson & Co	4,67 %	06.06.2047	45.923	0,04
75.000	Berry Global Inc	1,57 %	15.01.2026	67.684	0,06
100.000	Best Buy Co Inc	4,45 %	01.10.2028	96.764	0,08
25.000	Biogen Inc	3,15 %	01.05.2050	17.151	0,01
37.000	Biogen Inc	3,25 %	15.02.2051	25.978	0,02
200.000	BlackRock Inc	2,40 %	30.04.2030	173.623	0,14
140.000	BlackRock Inc	1,90 %	28.01.2031	114.573	0,09
20.000	Blackstone Holdings Finance Co LLC '144A'	5,00 %	15.06.2044	17.200	0,01
25.000	Blackstone Holdings Finance Co LLC '144A'	3,20 %	30.01.2052	15.705	0,01
75.000	Blackstone Private Credit Fund	2,63 %	15.12.2026	63.675	0,05
100.000	Blackstone Private Credit Fund	4,00 %	15.01.2029	84.193	0,07
100.000	Blue Owl Capital Corp	4,25 %	15.01.2026	92.646	0,08
100.000	BMW US Capital LLC '144A'	4,15 %	09.04.2030	95.724	0,08
75.000	Booking Holdings Inc	4,63 %	13.04.2030	73.160	0,06
50.000	BorgWarner Inc	2,65 %	01.07.2027	45.527	0,04
100.000	Boston Properties LP	3,65 %	01.02.2026	92.944	0,08
200.000	Boston Properties LP	2,75 %	01.10.2026	177.329	0,14
10.000	Boston Properties LP	4,50 %	01.12.2028	9.126	0,01
66.000	Boston Properties LP	3,25 %	30.01.2031	53.823	0,04
50.000	Boston Scientific Corp	2,65 %	01.06.2030	43.671	0,04
75.000	Bristol-Myers Squibb Co	2,90 %	26.07.2024	73.056	0,06
150.000	Bristol-Myers Squibb Co	3,20 %	15.06.2026	143.622	0,12
75.000	Bristol-Myers Squibb Co	3,90 %	20.02.2028	72.759	0,06
30.000	Bristol-Myers Squibb Co	4,13 %	15.06.2039	27.289	0,02
100.000	Bristol-Myers Squibb Co	4,25 %	26.10.2049	89.282	0,07
100.000	Bristol-Myers Squibb Co	2,55 %	13.11.2050	64.841	0,05
10.000	Bristol-Myers Squibb Co	3,90 %	15.03.2062	8.080	0,01
50.000	Brixmor Operating Partnership LP	4,13 %	15.06.2026	46.738	0,04
75.000	Broadcom Inc	3,46 %	15.09.2026	70.834	0,06

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
100.000	Broadcom Inc	4,75 %	15.04.2029	96.823	0,08
26.000	Broadcom Inc	4,15 %	15.11.2030	23.865	0,02
140.000	Broadcom Inc	4,30 %	15.11.2032	127.716	0,10
50.000	Broadcom Inc '144A'	2,45 %	15.02.2031	40.695	0,03
130.000	Broadcom Inc '144A'	2,60 %	15.02.2033	101.658	0,08
126.000	Broadcom Inc '144A'	3,47 %	15.04.2034	103.186	0,08
133.000	Broadcom Inc '144A'	4,93 %	15.05.2037	120.404	0,10
10.000	Broadcom Inc '144A'	3,50 %	15.02.2041	7.495	0,01
50.000	Broadcom Inc '144A'	3,75 %	15.02.2051	36.820	0,03
100.000	Brooklyn Union Gas Co/The '144A'	4,50 %	10.03.2046	78.677	0,06
250.000	Brown & Brown Inc	2,38 %	15.03.2031	201.734	0,16
100.000	California Institute of Technology	3,65 %	01.09.2119	68.168	0,06
150.000	Cameron LNG LLC '144A'	3,70 %	15.01.2039	123.722	0,10
25.000	Campbell Soup Co	4,15 %	15.03.2028	23.944	0,02
57.000	Campbell Soup Co	4,80 %	15.03.2048	51.779	0,04
100.000	Capital One Financial Corp	3,90 %	29.01.2024	98.463	0,08
25.000	Capital One Financial Corp	4,20 %	29.10.2025	23.923	0,02
100.000	Capital One Financial Corp	3,75 %	28.07.2026	93.228	0,08
175.000	Capital One Financial Corp	3,80 %	31.01.2028	161.256	0,13
100.000	Capital One Financial Corp FRN	1,88 %	02.11.2027	85.966	0,07
100.000	Capital One Financial Corp FRN	2,36 %	29.07.2032	70.483	0,06
43.000	Cardinal Health Inc	3,41 %	15.06.2027	40.470	0,03
50.000	Cargill Inc '144A'	4,50 %	24.06.2026	49.266	0,04
250.000	Carlisle Cos Inc	2,75 %	01.03.2030	212.672	0,17
200.000	Carlisle Cos Inc	2,20 %	01.03.2032	157.559	0,13
125.000	Caterpillar Financial Services Corp	4,35 %	15.05.2026	122.981	0,10
100.000	Caterpillar Financial Services Corp 'MTN'	0,45 %	14.09.2023	99.010	0,08
100.000	Caterpillar Financial Services Corp 'MTN'	2,15 %	08.11.2024	95.853	0,08
50.000	Caterpillar Financial Services Corp 'MTN'	0,80 %	13.11.2025	45.238	0,04
100.000	Caterpillar Inc	2,60 %	09.04.2030	88.791	0,07

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
51.000	Caterpillar Inc	3,80 %	15.08.2042	44.727	0,04
50.000	Caterpillar Inc	3,25 %	19.09.2049	39.058	0,03
100.000	CBRE Services Inc	5,95 %	15.08.2034	98.499	0,08
100.000	CDW LLC / CDW Finance Corp	2,67 %	01.12.2026	90.016	0,07
30.000	CDW LLC / CDW Finance Corp	3,57 %	01.12.2031	25.395	0,02
700.000	Centene Corp	2,63 %	01.08.2031	559.566	0,46
50.000	CF Industries Inc	5,15 %	15.03.2034	47.988	0,04
50.000	CF Industries Inc	4,95 %	01.06.2043	43.458	0,04
50.000	CF Industries Inc '144A'	4,50 %	01.12.2026	48.253	0,04
30.000	Charles Schwab Corp/The	0,75 %	18.03.2024	28.985	0,02
100.000	Charles Schwab Corp/The	0,90 %	11.03.2026	88.407	0,07
100.000	Charles Schwab Corp/The	3,30 %	01.04.2027	92.911	0,08
75.000	Charles Schwab Corp/The	1,65 %	11.03.2031	57.614	0,05
25.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4,91 %	23.07.2025	24.558	0,02
200.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4,20 %	15.03.2028	187.696	0,15
100.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4,40 %	01.04.2033	87.783	0,07
70.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3,50 %	01.06.2041	47.276	0,04
92.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	6,48 %	23.10.2045	86.592	0,07
80.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4,80 %	01.03.2050	60.466	0,05
50.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3,90 %	01.06.2052	32.707	0,03
50.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	5,13 %	30.06.2027	49.016	0,04
150.000	Cheniere Energy Partners LP	3,25 %	31.01.2032	123.841	0,10
100.000	Chevron Phillips Chemical Co LLC / Chevron Phillips Chemical Co LP '144A'	3,40 %	01.12.2026	94.833	0,08
10.000	Chubb Corp/The	6,50 %	15.05.2038	11.154	0,01
50.000	Chubb INA Holdings Inc	3,35 %	15.05.2024	49.040	0,04
25.000	Chubb INA Holdings Inc	4,35 %	03.11.2045	22.578	0,02
50.000	Cigna Corp	3,00 %	15.07.2023	49.950	0,04
100.000	Cigna Group/The	3,25 %	15.04.2025	95.790	0,08
50.000	Cigna Group/The	3,40 %	01.03.2027	47.083	0,04

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
75.000	Cigna Group/The	4,38 %	15.10.2028	72.578	0,06
50.000	Cigna Group/The	4,80 %	15.08.2038	47.245	0,04
150.000	Cigna Group/The	4,90 %	15.12.2048	139.782	0,11
50.000	Cigna Group/The	2,40 %	15.03.2030	42.502	0,03
25.000	Cisco Systems Inc	3,63 %	04.03.2024	24.691	0,02
100.000	Cisco Systems Inc	2,95 %	28.02.2026	95.968	0,08
77.000	Cisco Systems Inc	5,90 %	15.02.2039	85.217	0,07
50.000	Citadel LP '144A'	4,88 %	15.01.2027	48.052	0,04
100.000	Citigroup Inc	3,75 %	16.06.2024	98.138	0,08
100.000	Citigroup Inc	4,40 %	10.06.2025	97.085	0,08
125.000	Citigroup Inc	4,13 %	25.07.2028	117.727	0,10
30.000	Citigroup Inc	6,63 %	15.06.2032	31.756	0,03
66.000	Citigroup Inc	8,13 %	15.07.2039	83.984	0,07
25.000	Citigroup Inc	6,68 %	13.09.2043	27.040	0,02
50.000	Citigroup Inc	4,65 %	30.07.2045	44.394	0,04
66.000	Citigroup Inc	4,75 %	18.05.2046	56.270	0,05
50.000	Citigroup Inc	4,65 %	23.07.2048	45.142	0,04
100.000	Citigroup Inc FRN	0,98 %	01.05.2025	95.750	0,08
250.000	Citigroup Inc FRN	3,11 %	08.04.2026	238.816	0,20
30.000	Citigroup Inc FRN	6,78 %	01.07.2026	30.295	0,02
125.000	Citigroup Inc FRN	3,89 %	10.01.2028	118.537	0,10
50.000	Citigroup Inc FRN	3,52 %	27.10.2028	46.429	0,04
30.000	Citigroup Inc FRN	4,08 %	23.04.2029	28.259	0,02
200.000	Citigroup Inc FRN	3,98 %	20.03.2030	184.555	0,15
50.000	Citigroup Inc FRN	2,98 %	05.11.2030	43.373	0,04
200.000	Citigroup Inc FRN	2,67 %	29.01.2031	169.204	0,14
100.000	Citigroup Inc FRN	4,41 %	31.03.2031	93.954	0,08
50.000	Citigroup Inc FRN	2,57 %	03.06.2031	41.681	0,03
200.000	Citigroup Inc FRN	2,56 %	01.05.2032	163.848	0,13
50.000	Citigroup Inc FRN	2,52 %	03.11.2032	40.248	0,03

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
50.000	Citigroup Inc FRN	3,06 %	25.01.2033	41.783	0,03
75.000	Citigroup Inc FRN	3,79 %	17.03.2033	66.315	0,05
50.000	Citigroup Inc FRN	6,27 %	17.11.2033	53.218	0,04
163.000	Citigroup Inc FRN	6,17 %	25.05.2034	164.095	0,13
100.000	Citizens Financial Group Inc	3,25 %	30.04.2030	81.797	0,07
130.000	CME Group Inc	5,30 %	15.09.2043	135.732	0,11
100.000	CNA Financial Corp	3,45 %	15.08.2027	92.823	0,08
50.000	CNH Industrial Capital LLC	1,45 %	15.07.2026	44.230	0,04
200.000	Coca-Cola Co/The	1,00 %	15.03.2028	172.161	0,14
50.000	Coca-Cola Co/The	2,50 %	01.06.2040	37.805	0,03
20.000	Coca-Cola Co/The	2,75 %	01.06.2060	13.828	0,01
42.000	Colonial Enterprises Inc '144A'	3,25 %	15.05.2030	37.510	0,03
100.000	Columbia Pipeline Group Inc	4,50 %	01.06.2025	97.670	0,08
50.000	Comcast Corp	3,30 %	01.02.2027	47.524	0,04
100.000	Comcast Corp	3,15 %	15.02.2028	93.142	0,08
150.000	Comcast Corp	1,50 %	15.02.2031	119.068	0,10
100.000	Comcast Corp	4,65 %	15.02.2033	99.279	0,08
200.000	Comcast Corp	5,65 %	15.06.2035	209.973	0,17
234.000	Comcast Corp	3,90 %	01.03.2038	203.935	0,17
50.000	Comcast Corp	4,70 %	15.10.2048	47.016	0,04
50.000	Comcast Corp	3,45 %	01.02.2050	38.209	0,03
50.000	Comcast Corp	2,80 %	15.01.2051	33.279	0,03
100.000	Comcast Corp	2,89 %	01.11.2051	67.386	0,05
50.000	Comcast Corp	2,45 %	15.08.2052	30.799	0,02
50.000	Comcast Corp	4,05 %	01.11.2052	41.632	0,03
39.000	Comcast Corp	2,94 %	01.11.2056	25.546	0,02
50.000	Commonwealth Edison Co	2,55 %	15.06.2026	46.710	0,04
100.000	Commonwealth Edison Co	3,70 %	15.08.2028	94.321	0,08
100.000	Commonwealth Edison Co	3,65 %	15.06.2046	77.697	0,06
150.000	Commonwealth Edison Co	3,75 %	15.08.2047	118.894	0,10

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
100.000	Conagra Brands Inc	4,30 %	01.05.2024	98.616	0,08
46.000	Conagra Brands Inc	5,40 %	01.11.2048	44.067	0,04
100.000	Connecticut Light and Power Co/The	4,00 %	01.04.2048	84.870	0,07
150.000	Consolidated Edison Co of New York Inc	4,45 %	15.03.2044	131.862	0,11
250.000	Consolidated Edison Co of New York Inc	4,50 %	01.12.2045	216.893	0,18
100.000	Consolidated Edison Co of New York Inc	3,95 %	01.04.2050	81.514	0,07
10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc	6,15 %	15.11.2052	10.992	0,01
125.000	Consolidated Edison Co of New York Inc	3,00 %	01.12.2060	79.577	0,06
100.000	Constellation Brands Inc	3,50 %	09.05.2027	94.438	0,08
125.000	Constellation Brands Inc	3,15 %	01.08.2029	111.436	0,09
20.000	Constellation Brands Inc	4,50 %	09.05.2047	17.382	0,01
60.000	Constellation Energy Generation LLC	5,80 %	01.03.2033	61.553	0,05
100.000	Corebridge Financial Inc	4,40 %	05.04.2052	78.674	0,06
10.000	Corning Inc	5,35 %	15.11.2048	9.741	0,01
200.000	Corning Inc	5,45 %	15.11.2079	180.191	0,15
100.000	Cox Communications Inc '144A'	3,50 %	15.08.2027	93.028	0,08
100.000	Cox Communications Inc '144A'	4,50 %	30.06.2043	82.582	0,07
50.000	Crown Castle Inc	4,45 %	15.02.2026	48.661	0,04
25.000	Crown Castle Inc	4,00 %	01.03.2027	23.787	0,02
50.000	Crown Castle Inc	3,65 %	01.09.2027	46.791	0,04
40.000	Crown Castle Inc	2,25 %	15.01.2031	32.679	0,03
200.000	Crown Castle Inc	2,10 %	01.04.2031	160.581	0,13
20.000	Crown Castle Inc	2,90 %	01.04.2041	14.023	0,01
20.000	Crown Castle Inc	3,25 %	15.01.2051	13.697	0,01
100.000	CSX Corp	4,25 %	15.03.2029	96.803	0,08
150.000	CSX Corp	3,80 %	01.11.2046	120.266	0,10
25.000	CSX Corp	3,95 %	01.05.2050	20.419	0,02
50.000	CVS Health Corp	3,88 %	20.07.2025	48.635	0,04
131.000	CVS Health Corp	5,00 %	20.02.2026	130.401	0,11
100.000	CVS Health Corp	3,63 %	01.04.2027	94.939	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
50.000	CVS Health Corp	4,30 %	25.03.2028	48.175	0,04
100.000	CVS Health Corp	3,25 %	15.08.2029	89.737	0,07
50.000	CVS Health Corp	5,13 %	21.02.2030	49.693	0,04
210.000	CVS Health Corp	1,75 %	21.08.2030	167.857	0,14
100.000	CVS Health Corp	5,25 %	21.02.2033	99.504	0,08
40.000	CVS Health Corp	4,78 %	25.03.2038	37.009	0,03
100.000	CVS Health Corp	5,05 %	25.03.2048	92.793	0,08
125.000	CVS Health Corp	5,88 %	01.06.2053	128.278	0,10
40.000	CVS Health Corp	6,00 %	01.06.2063	41.238	0,03
150.000	Daimler Truck Finance North America LLC '144A'	2,00 %	14.12.2026	133.943	0,11
50.000	Danaher Corp	4,38 %	15.09.2045	45.232	0,04
100.000	Deere & Co	2,75 %	15.04.2025	95.898	0,08
100.000	Dell International LLC / EMC Corp	5,30 %	01.10.2029	98.862	0,08
250.000	Dell International LLC / EMC Corp	6,20 %	15.07.2030	259.706	0,21
125.000	Dell International LLC / EMC Corp	8,10 %	15.07.2036	145.716	0,12
120.000	DENTSPLY SIRONA Inc	3,25 %	01.06.2030	103.866	0,08
75.000	Devon Energy Corp	5,60 %	15.07.2041	69.965	0,06
100.000	Digital Realty Trust LP	3,70 %	15.08.2027	91.732	0,07
250.000	Discover Bank 'BKNT' FRN	4,68 %	09.08.2028	223.437	0,18
50.000	Discover Financial Services	4,10 %	09.02.2027	46.557	0,04
100.000	Discovery Communications LLC	5,20 %	20.09.2047	81.806	0,07
25.000	Discovery Communications LLC	4,65 %	15.05.2050	19.029	0,02
75.000	Dow Chemical Co/The	4,38 %	15.11.2042	63.359	0,05
25.000	Dow Chemical Co/The	3,60 %	15.11.2050	18.655	0,02
130.000	DuPont de Nemours Inc	4,73 %	15.11.2028	127.888	0,10
25.000	DuPont de Nemours Inc	5,42 %	15.11.2048	24.602	0,02
100.000	Eastman Chemical Co	4,50 %	01.12.2028	95.326	0,08
50.000	Eaton Corp	4,35 %	18.05.2028	49.061	0,04
50.000	Eaton Corp	4,15 %	15.03.2033	47.400	0,04
50.000	Eaton Corp	4,15 %	02.11.2042	44.495	0,04

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
30.000	eBay Inc	3,45 %	01.08.2024	29.375	0,02
75.000	eBay Inc	3,60 %	05.06.2027	70.971	0,06
50.000	Ecolab Inc	4,80 %	24.03.2030	49.950	0,04
100.000	Edison International	3,55 %	15.11.2024	96.750	0,08
60.000	Edison International	5,25 %	15.11.2028	58.360	0,05
10.000	Elevance Health Inc	2,38 %	15.01.2025	9.508	0,01
10.000	Elevance Health Inc	4,10 %	01.03.2028	9.609	0,01
200.000	Elevance Health Inc	2,88 %	15.09.2029	175.872	0,14
100.000	Elevance Health Inc	4,38 %	01.12.2047	87.379	0,07
40.000	Elevance Health Inc	3,70 %	15.09.2049	31.082	0,03
125.000	Elevance Health Inc	3,13 %	15.05.2050	88.062	0,07
42.000	Eli Lilly & Co	4,70 %	27.02.2033	42.552	0,03
100.000	Eli Lilly & Co	2,25 %	15.05.2050	65.566	0,05
365.000	EMD Finance LLC '144A'	3,25 %	19.03.2025	350.050	0,29
100.000	Emerson Electric Co	1,95 %	15.10.2030	83.287	0,07
50.000	Enterprise Products Operating LLC	3,75 %	15.02.2025	48.481	0,04
50.000	Enterprise Products Operating LLC	4,15 %	16.10.2028	47.814	0,04
210.000	Enterprise Products Operating LLC	2,80 %	31.01.2030	184.270	0,15
27.000	Enterprise Products Operating LLC	4,25 %	15.02.2048	23.006	0,02
48.000	Enterprise Products Operating LLC	4,20 %	31.01.2050	40.073	0,03
69.000	Enterprise Products Operating LLC	3,20 %	15.02.2052	48.704	0,04
100.000	Enterprise Products Operating LLC FRN	8,30 %	16.08.2077	98.750	0,08
25.000	EOG Resources Inc	4,15 %	15.01.2026	24.475	0,02
50.000	EOG Resources Inc	4,95 %	15.04.2050	49.334	0,04
200.000	Equinix Inc	2,63 %	18.11.2024	191.602	0,16
75.000	Equitable Holdings Inc	4,35 %	20.04.2028	70.178	0,06
35.000	Equitable Holdings Inc	5,00 %	20.04.2048	30.107	0,02
50.000	ERAC USA Finance LLC '144A'	3,85 %	15.11.2024	48.611	0,04
50.000	ERAC USA Finance LLC '144A'	7,00 %	15.10.2037	57.039	0,05
85.000	ERP Operating LP	3,00 %	01.07.2029	75.089	0,06

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
20.000	Essex Portfolio LP	2,65 %	15.03.2032	16.073	0,01
150.000	Estee Lauder Cos Inc/The	2,38 %	01.12.2029	129.387	0,11
25.000	Estee Lauder Cos Inc/The	3,13 %	01.12.2049	18.257	0,01
50.000	Eversource Energy	4,25 %	01.04.2029	47.521	0,04
51.000	Exelon Corp	5,10 %	15.06.2045	47.441	0,04
30.000	Expedia Group Inc '144A'	6,25 %	01.05.2025	30.087	0,02
20.000	Farmers Exchange Capital III '144A' FRN	5,45 %	15.10.2054	17.892	0,01
45.000	Federal Realty OP LP	4,50 %	01.12.2044	35.522	0,03
30.000	FedEx Corp	3,40 %	15.02.2028	27.949	0,02
50.000	FedEx Corp	4,10 %	15.04.2043	40.492	0,03
40.000	FedEx Corp	4,10 %	01.02.2045	32.332	0,03
100.000	FedEx Corp	4,05 %	15.02.2048	80.187	0,07
90.000	Fifth Third Bancorp	2,55 %	05.05.2027	79.556	0,06
100.000	Fifth Third Bancorp	8,25 %	01.03.2038	115.157	0,09
100.000	Fifth Third Bancorp FRN	6,36 %	27.10.2028	99.478	0,08
200.000	Fifth Third Bank NA 'BKNT'	3,95 %	28.07.2025	190.279	0,16
100.000	Fiserv Inc	2,75 %	01.07.2024	97.072	0,08
100.000	Fiserv Inc	3,50 %	01.07.2029	91.261	0,07
100.000	Five Corners Funding Trust II '144A'	2,85 %	15.05.2030	85.143	0,07
150.000	Five Corners Funding Trust IV '144A'	6,00 %	15.02.2053	152.317	0,12
193.000	Florida Gas Transmission Co LLC '144A'	2,55 %	01.07.2030	160.869	0,13
50.000	FMC Corp	5,15 %	18.05.2026	49.248	0,04
25.000	Fortune Brands Innovations Inc	4,00 %	15.06.2025	24.155	0,02
49.000	Fox Corp	5,58 %	25.01.2049	45.495	0,04
50.000	Freeport-McMoRan Inc	4,55 %	14.11.2024	49.067	0,04
200.000	Freeport-McMoRan Inc	4,63 %	01.08.2030	188.718	0,15
40.000	Freeport-McMoRan Inc	5,45 %	15.03.2043	37.230	0,03
600.000	Fresenius Medical Care US Finance III Inc '144A'	2,38 %	16.02.2031	454.619	0,37
70.000	GA Global Funding Trust '144A'	1,63 %	15.01.2026	62.130	0,05
100.000	GE HealthCare Technologies Inc	6,38 %	22.11.2052	111.317	0,09

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
50.000	General Electric Co	6,75 %	15.03.2032	56.376	0,05
25.000	General Mills Inc	4,20 %	17.04.2028	24.290	0,02
25.000	General Motors Co	6,13 %	01.10.2025	25.163	0,02
10.000	General Motors Co	6,60 %	01.04.2036	10.221	0,01
10.000	General Motors Co	5,15 %	01.04.2038	8.882	0,01
75.000	General Motors Co	6,25 %	02.10.2043	72.896	0,06
100.000	General Motors Co	5,20 %	01.04.2045	85.607	0,07
75.000	General Motors Financial Co Inc	3,95 %	13.04.2024	73.832	0,06
100.000	General Motors Financial Co Inc	4,35 %	17.01.2027	95.978	0,08
135.000	General Motors Financial Co Inc	5,80 %	23.06.2028	134.657	0,11
50.000	General Motors Financial Co Inc	6,40 %	09.01.2033	50.962	0,04
240.000	Georgia-Pacific LLC '144A'	1,75 %	30.09.2025	220.387	0,18
40.000	Gilead Sciences Inc	3,65 %	01.03.2026	38.452	0,03
100.000	Gilead Sciences Inc	1,65 %	01.10.2030	81.580	0,07
100.000	Gilead Sciences Inc	4,00 %	01.09.2036	90.287	0,07
69.000	Gilead Sciences Inc	5,65 %	01.12.2041	72.765	0,06
50.000	Gilead Sciences Inc	4,80 %	01.04.2044	47.528	0,04
100.000	Gilead Sciences Inc	4,50 %	01.02.2045	91.200	0,07
100.000	GlaxoSmithKline Capital Inc	3,63 %	15.05.2025	97.294	0,08
50.000	Global Payments Inc	2,90 %	15.05.2030	42.346	0,03
50.000	Global Payments Inc	5,95 %	15.08.2052	47.793	0,04
75.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc	5,30 %	15.01.2029	71.062	0,06
200.000	Goldman Sachs Group Inc/The	4,00 %	03.03.2024	197.607	0,16
140.000	Goldman Sachs Group Inc/The	3,50 %	01.04.2025	134.696	0,11
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The	4,25 %	21.10.2025	96.290	0,08
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The	3,85 %	26.01.2027	95.047	0,08
75.000	Goldman Sachs Group Inc/The	2,60 %	07.02.2030	63.881	0,05
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The	3,80 %	15.03.2030	46.273	0,04
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The	6,13 %	15.02.2033	53.215	0,04
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The	6,75 %	01.10.2037	107.482	0,09

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
150.000	Goldman Sachs Group Inc/The	6,25 %	01.02.2041	161.227	0,13
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The	4,75 %	21.10.2045	45.468	0,04
75.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	1,09 %	09.12.2026	66.898	0,05
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	3,62 %	15.03.2028	46.998	0,04
175.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	3,69 %	05.06.2028	164.542	0,13
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	4,48 %	23.08.2028	48.388	0,04
75.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	3,81 %	23.04.2029	69.722	0,06
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	4,22 %	01.05.2029	94.618	0,08
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	1,99 %	27.01.2032	31.506	0,03
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	2,62 %	22.04.2032	40.959	0,03
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	2,38 %	21.07.2032	80.129	0,07
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	2,65 %	21.10.2032	81.472	0,07
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	3,10 %	24.02.2033	42.346	0,03
150.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	4,41 %	23.04.2039	131.319	0,11
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	3,21 %	22.04.2042	29.710	0,02
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	3,44 %	24.02.2043	7.588	0,01
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'GMTN' FRN	7,02 %	28.10.2027	50.911	0,04
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'MTN' FRN	7,06 %	29.11.2023	40.127	0,03
140.000	Great-West Lifeco Finance 2018 LP '144A'	4,58 %	17.05.2048	119.339	0,10
50.000	Halliburton Co	7,45 %	15.09.2039	57.948	0,05
244.000	Halliburton Co	4,75 %	01.08.2043	214.441	0,18
200.000	Halliburton Co	5,00 %	15.11.2045	181.756	0,15
20.000	Hartford Financial Services Group Inc/The	2,80 %	19.08.2029	17.226	0,01
50.000	Hartford Financial Services Group Inc/The '144A' FRN	7,45 %	12.02.2047	41.875	0,03
50.000	Hasbro Inc	3,90 %	19.11.2029	45.161	0,04
50.000	HCA Inc	5,00 %	15.03.2024	49.626	0,04
300.000	HCA Inc	5,25 %	15.06.2026	296.871	0,24
50.000	HCA Inc	5,13 %	15.06.2039	46.187	0,04
100.000	HCA Inc	5,50 %	15.06.2047	94.473	0,08
25.000	HCA Inc	5,25 %	15.06.2049	22.304	0,02

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
100.000	HCA Inc '144A'	4,38 %	15.03.2042	82.572	0,07
100.000	Healthpeak OP LLC	5,25 %	15.12.2032	97.338	0,08
140.000	Hess Corp	4,30 %	01.04.2027	134.558	0,11
201.000	Hewlett Packard Enterprise Co	6,35 %	15.10.2045	209.196	0,17
100.000	Hormel Foods Corp	1,80 %	11.06.2030	83.490	0,07
100.000	HP Inc	1,45 %	17.06.2026	89.708	0,07
70.000	HP Inc	3,00 %	17.06.2027	64.369	0,05
25.000	HP Inc	6,00 %	15.09.2041	25.267	0,02
153.000	Humana Inc	3,85 %	01.10.2024	150.162	0,12
100.000	Huntington Bancshares Inc/OH	4,00 %	15.05.2025	95.830	0,08
100.000	Hyundai Capital America '144A'	1,80 %	15.10.2025	91.253	0,07
240.000	Hyundai Capital America '144A'	2,38 %	15.10.2027	210.064	0,17
25.000	Hyundai Capital America '144A'	6,38 %	08.04.2030	25.929	0,02
50.000	Hyundai Capital America 'REGS'	5,70 %	26.06.2030	49.616	0,04
10.000	Illinois Tool Works Inc	2,65 %	15.11.2026	9.368	0,01
40.000	Intel Corp	3,40 %	25.03.2025	38.770	0,03
100.000	Intel Corp	3,70 %	29.07.2025	97.076	0,08
100.000	Intel Corp	4,88 %	10.02.2028	99.692	0,08
100.000	Intel Corp	3,90 %	25.03.2030	94.348	0,08
100.000	Intel Corp	2,00 %	12.08.2031	81.730	0,07
100.000	Intel Corp	4,15 %	05.08.2032	95.311	0,08
50.000	Intel Corp	5,20 %	10.02.2033	50.584	0,04
70.000	Intel Corp	4,60 %	25.03.2040	65.199	0,05
10.000	Intel Corp	5,63 %	10.02.2043	10.150	0,01
50.000	Intel Corp	4,10 %	19.05.2046	42.030	0,03
25.000	Intel Corp	4,75 %	25.03.2050	22.567	0,02
286.000	Intel Corp	3,05 %	12.08.2051	191.895	0,16
10.000	Intel Corp	5,70 %	10.02.2053	10.189	0,01
150.000	Intel Corp	3,10 %	15.02.2060	96.516	0,08
25.000	Intel Corp	4,95 %	25.03.2060	22.940	0,02

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
50.000	Intel Corp	5,90 %	10.02.2063	51.390	0,04
50.000	Intercontinental Exchange Inc	3,65 %	23.05.2025	49.015	0,04
50.000	Intercontinental Exchange Inc	3,75 %	01.12.2025	48.563	0,04
50.000	Intercontinental Exchange Inc	2,10 %	15.06.2030	41.954	0,03
10.000	Intercontinental Exchange Inc	4,60 %	15.03.2033	9.718	0,01
50.000	Intercontinental Exchange Inc	4,25 %	21.09.2048	43.331	0,04
50.000	Intercontinental Exchange Inc	4,95 %	15.06.2052	47.464	0,04
100.000	International Business Machines Corp	3,63 %	12.02.2024	98.524	0,08
100.000	International Business Machines Corp	3,45 %	19.02.2026	95.844	0,08
100.000	International Business Machines Corp	3,30 %	15.05.2026	95.414	0,08
100.000	International Business Machines Corp	4,15 %	27.07.2027	97.190	0,08
100.000	International Business Machines Corp	3,50 %	15.05.2029	92.414	0,08
40.000	International Business Machines Corp	5,88 %	29.11.2032	42.544	0,03
100.000	International Business Machines Corp	4,75 %	06.02.2033	98.075	0,08
50.000	International Business Machines Corp	4,00 %	20.06.2042	42.356	0,03
100.000	International Business Machines Corp	4,25 %	15.05.2049	85.356	0,07
40.000	International Flavors & Fragrances Inc '144A'	1,23 %	01.10.2025	35.622	0,03
190.000	International Flavors & Fragrances Inc '144A'	2,30 %	01.11.2030	150.959	0,12
75.000	International Paper Co	4,80 %	15.06.2044	66.583	0,05
40.000	Interpublic Group of Cos Inc/The	3,38 %	01.03.2041	29.228	0,02
100.000	Intuit Inc	0,65 %	15.07.2023	99.842	0,08
100.000	J M Smucker Co/The	2,38 %	15.03.2030	85.236	0,07
5.000	J M Smucker Co/The	4,25 %	15.03.2035	4.543	0,00
75.000	Jefferies Financial Group Inc	4,15 %	23.01.2030	67.371	0,05
100.000	John Deere Capital Corp	1,45 %	15.01.2031	79.884	0,07
100.000	John Deere Capital Corp 'MTN'	2,65 %	24.06.2024	97.222	0,08
150.000	John Deere Capital Corp 'MTN'	4,15 %	15.09.2027	146.485	0,12
75.000	John Deere Capital Corp 'MTN'	2,45 %	09.01.2030	65.854	0,05
100.000	John Deere Capital Corp 'MTN'	3,90 %	07.06.2032	94.450	0,08
50.000	Johnson & Johnson	2,95 %	03.03.2027	47.565	0,04

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
100.000	Johnson & Johnson	4,38 %	05.12.2033	100.852	0,08
30.000	Johnson & Johnson	2,10 %	01.09.2040	21.146	0,02
147.000	Johnson & Johnson	3,50 %	15.01.2048	124.653	0,10
100.000	Johnson & Johnson	2,25 %	01.09.2050	66.507	0,05
50.000	JPMorgan Chase & Co	3,88 %	10.09.2024	48.827	0,04
100.000	JPMorgan Chase & Co	3,13 %	23.01.2025	96.781	0,08
42.000	JPMorgan Chase & Co	2,95 %	01.10.2026	39.374	0,03
100.000	JPMorgan Chase & Co	7,63 %	15.10.2026	106.143	0,09
25.000	JPMorgan Chase & Co	4,13 %	15.12.2026	24.082	0,02
50.000	JPMorgan Chase & Co	8,00 %	29.04.2027	54.840	0,04
100.000	JPMorgan Chase & Co	4,25 %	01.10.2027	96.756	0,08
25.000	JPMorgan Chase & Co	3,63 %	01.12.2027	23.446	0,02
40.000	JPMorgan Chase & Co	5,40 %	06.01.2042	40.430	0,03
50.000	JPMorgan Chase & Co	5,63 %	16.08.2043	51.229	0,04
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN	6,16 %	23.07.2024	100.082	0,08
125.000	JPMorgan Chase & Co FRN	3,22 %	01.03.2025	122.681	0,10
150.000	JPMorgan Chase & Co FRN	0,97 %	23.06.2025	142.401	0,12
200.000	JPMorgan Chase & Co FRN	2,30 %	15.10.2025	190.870	0,16
300.000	JPMorgan Chase & Co FRN	5,55 %	15.12.2025	299.137	0,24
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN	2,01 %	13.03.2026	94.021	0,08
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN	2,08 %	22.04.2026	93.704	0,08
200.000	JPMorgan Chase & Co FRN	4,08 %	26.04.2026	194.612	0,16
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN	1,05 %	19.11.2026	89.757	0,07
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN	1,58 %	22.04.2027	35.983	0,03
125.000	JPMorgan Chase & Co FRN	3,78 %	01.02.2028	119.271	0,10
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN	2,95 %	24.02.2028	91.806	0,07
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN	3,51 %	23.01.2029	92.566	0,08
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN	2,07 %	01.06.2029	42.929	0,03
200.000	JPMorgan Chase & Co FRN	2,74 %	15.10.2030	171.918	0,14
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN	1,95 %	04.02.2032	79.729	0,07

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
175.000	JPMorgan Chase & Co FRN	2,58 %	22.04.2032	145.174	0,12
200.000	JPMorgan Chase & Co FRN	2,55 %	08.11.2032	163.863	0,13
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN	4,91 %	25.07.2033	98.014	0,08
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN	3,88 %	24.07.2038	34.469	0,03
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN	3,11 %	22.04.2041	30.335	0,02
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN	3,16 %	22.04.2042	30.037	0,02
34.000	JPMorgan Chase & Co FRN	4,26 %	22.02.2048	29.472	0,02
80.000	JPMorgan Chase & Co FRN	3,96 %	15.11.2048	66.137	0,05
75.000	JPMorgan Chase & Co FRN	3,11 %	22.04.2051	52.799	0,04
175.000	JPMorgan Chase & Co FRN	3,33 %	22.04.2052	128.257	0,10
50.000	Kaiser Foundation Hospitals	2,81 %	01.06.2041	36.834	0,03
50.000	Kaiser Foundation Hospitals	4,15 %	01.05.2047	44.035	0,04
10.000	Kansas City Southern/Old	4,70 %	01.05.2048	8.760	0,01
40.000	Kellogg Co	3,40 %	15.11.2027	37.428	0,03
40.000	Kellogg Co	2,10 %	01.06.2030	33.244	0,03
75.000	Kenvue Inc '144A'	5,35 %	22.03.2026	75.568	0,06
125.000	Kenvue Inc '144A'	4,90 %	22.03.2033	126.565	0,10
50.000	Kenvue Inc '144A'	5,05 %	22.03.2053	50.916	0,04
68.000	Keurig Dr Pepper Inc	3,20 %	01.05.2030	60.971	0,05
20.000	Keurig Dr Pepper Inc	4,50 %	15.04.2052	17.643	0,01
250.000	KeyBank NA/Cleveland OH 'BKNT'	3,40 %	20.05.2026	215.873	0,18
50.000	KeyCorp 'MTN' FRN	3,88 %	23.05.2025	46.297	0,04
100.000	Keysight Technologies Inc	3,00 %	30.10.2029	87.373	0,07
200.000	KeySpan Gas East Corp '144A'	2,74 %	15.08.2026	180.841	0,15
20.000	Kimberly-Clark Corp	3,95 %	01.11.2028	19.354	0,02
100.000	Kimberly-Clark Corp	3,20 %	25.04.2029	92.785	0,08
20.000	Kimberly-Clark Corp	3,10 %	26.03.2030	18.273	0,01
50.000	Kimberly-Clark Corp	6,63 %	01.08.2037	58.985	0,05
50.000	Kimco Realty OP LLC	2,70 %	01.10.2030	41.270	0,03
100.000	Kinder Morgan Inc	4,30 %	01.06.2025	97.542	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
40.000	Kinder Morgan Inc	2,00 %	15.02.2031	31.719	0,03
126.000	Kinder Morgan Inc	5,30 %	01.12.2034	121.257	0,10
100.000	Kinder Morgan Inc	5,55 %	01.06.2045	92.161	0,08
150.000	Kinder Morgan Inc 'GMTN'	7,75 %	15.01.2032	169.823	0,14
70.000	KKR Group Finance Co II LLC '144A'	5,50 %	01.02.2043	64.174	0,05
50.000	KLA Corp	3,30 %	01.03.2050	37.795	0,03
50.000	KLA Corp	5,25 %	15.07.2062	50.978	0,04
100.000	Kohl's Corp	4,63 %	01.05.2031	69.825	0,06
100.000	Kraft Heinz Foods Co	5,20 %	15.07.2045	95.424	0,08
100.000	Kraft Heinz Foods Co '144A'	7,13 %	01.08.2039	111.125	0,09
120.000	Kroger Co/The	4,65 %	15.01.2048	106.337	0,09
200.000	Kyndryl Holdings Inc	3,15 %	15.10.2031	150.441	0,12
350.000	Kyndryl Holdings Inc '144A'	4,10 %	15.10.2041	232.638	0,19
30.000	Laboratory Corp of America Holdings	3,25 %	01.09.2024	29.138	0,02
50.000	Laboratory Corp of America Holdings	3,60 %	01.09.2027	47.259	0,04
20.000	Laboratory Corp of America Holdings	2,95 %	01.12.2029	17.574	0,01
20.000	Laboratory Corp of America Holdings	4,70 %	01.02.2045	17.423	0,01
50.000	Lam Research Corp	3,75 %	15.03.2026	48.570	0,04
150.000	Lam Research Corp	4,88 %	15.03.2049	145.589	0,12
141.000	Lear Corp	3,80 %	15.09.2027	131.280	0,11
170.000	Liberty Mutual Group Inc '144A'	4,57 %	01.02.2029	159.904	0,13
100.000	Lincoln National Corp	3,40 %	15.01.2031	84.087	0,07
200.000	Lincoln National Corp	7,00 %	15.06.2040	207.985	0,17
75.000	Linde Inc/CT	3,20 %	30.01.2026	71.566	0,06
100.000	Lowe's Cos Inc	3,10 %	03.05.2027	93.432	0,08
100.000	Lowe's Cos Inc	1,70 %	15.10.2030	80.343	0,07
50.000	Lowe's Cos Inc	3,75 %	01.04.2032	45.287	0,04
50.000	Lowe's Cos Inc	5,00 %	15.04.2033	49.527	0,04
55.000	Lowe's Cos Inc	4,05 %	03.05.2047	44.397	0,04

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
50.000	Lowe's Cos Inc	5,63 %	15.04.2053	50.064	0,04
50.000	Lowe's Cos Inc	5,75 %	01.07.2053	50.860	0,04
25.000	Lowe's Cos Inc	5,80 %	15.09.2062	24.780	0,02
50.000	LYB International Finance III LLC	4,20 %	01.05.2050	38.382	0,03
40.000	Magellan Midstream Partners LP	3,25 %	01.06.2030	35.202	0,03
22.000	Magellan Midstream Partners LP	3,95 %	01.03.2050	15.649	0,01
250.000	Manufacturers & Traders Trust Co 'BKNT'	3,40 %	17.08.2027	214.916	0,18
69.000	Marathon Oil Corp	4,40 %	15.07.2027	65.932	0,05
150.000	Marathon Oil Corp	6,80 %	15.03.2032	155.394	0,13
30.000	Marathon Petroleum Corp	3,63 %	15.09.2024	29.221	0,02
75.000	Marathon Petroleum Corp	4,70 %	01.05.2025	73.566	0,06
50.000	Marathon Petroleum Corp	6,50 %	01.03.2041	51.253	0,04
75.000	Markel Group Inc	4,15 %	17.09.2050	59.124	0,05
6.000	Marriott International Inc/MD	5,75 %	01.05.2025	6.015	0,00
75.000	Marriott International Inc/MD	4,90 %	15.04.2029	72.927	0,06
300.000	Mars Inc '144A'	3,95 %	01.04.2049	254.619	0,21
10.000	Marsh & McLennan Cos Inc	4,38 %	15.03.2029	9.737	0,01
200.000	Marsh & McLennan Cos Inc	2,25 %	15.11.2030	165.914	0,14
10.000	Marsh & McLennan Cos Inc	4,75 %	15.03.2039	9.257	0,01
50.000	Martin Marietta Materials Inc	2,40 %	15.07.2031	40.665	0,03
30.000	Martin Marietta Materials Inc	4,25 %	15.12.2047	24.991	0,02
200.000	Marvell Technology Inc	1,65 %	15.04.2026	179.873	0,15
25.000	Masco Corp	1,50 %	15.02.2028	21.250	0,02
100.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A'	3,38 %	15.04.2050	71.517	0,06
40.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A'	3,73 %	15.10.2070	27.720	0,02
75.000	Mastercard Inc	3,30 %	26.03.2027	71.724	0,06
150.000	Mastercard Inc	3,35 %	26.03.2030	139.856	0,11
71.000	Mastercard Inc	3,80 %	21.11.2046	60.338	0,05
11.000	Mastercard Inc	2,95 %	15.03.2051	8.055	0,01
200.000	McCormick & Co Inc/MD	0,90 %	15.02.2026	178.223	0,15
40.000	McCormick & Co Inc/MD	3,40 %	15.08.2027	37.473	0,03

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
70.000	McCormick & Co Inc/MD	2,50 %	15.04.2030	59.402	0,05
100.000	McDonald's Corp 'MTN'	3,38 %	26.05.2025	96.634	0,08
200.000	McDonald's Corp 'MTN'	3,80 %	01.04.2028	191.899	0,16
80.000	McDonald's Corp 'MTN'	4,60 %	26.05.2045	72.707	0,06
50.000	McDonald's Corp 'MTN'	3,63 %	01.09.2049	39.503	0,03
100.000	MDC Holdings Inc	6,00 %	15.01.2043	90.801	0,07
126.000	Mead Johnson Nutrition Co	4,13 %	15.11.2025	123.063	0,10
100.000	Medtronic Inc	4,38 %	15.03.2035	96.058	0,08
150.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC '144A'	3,25 %	01.08.2024	145.886	0,12
150.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC '144A'	3,45 %	06.01.2027	141.855	0,12
50.000	Merck & Co Inc	2,75 %	10.02.2025	48.214	0,04
50.000	Merck & Co Inc	0,75 %	24.02.2026	45.188	0,04
75.000	Merck & Co Inc	3,40 %	07.03.2029	70.241	0,06
50.000	Merck & Co Inc	2,15 %	10.12.2031	41.392	0,03
20.000	Merck & Co Inc	3,90 %	07.03.2039	17.947	0,01
95.000	Merck & Co Inc	3,70 %	10.02.2045	80.428	0,07
50.000	Merck & Co Inc	2,45 %	24.06.2050	32.887	0,03
75.000	Merck & Co Inc	2,75 %	10.12.2051	51.654	0,04
40.000	Merck & Co Inc	2,90 %	10.12.2061	26.464	0,02
50.000	Merck & Co Inc	5,15 %	17.05.2063	51.015	0,04
100.000	Meta Platforms Inc	4,60 %	15.05.2028	99.016	0,08
50.000	Meta Platforms Inc	4,45 %	15.08.2052	43.286	0,04
100.000	MetLife Inc	3,60 %	10.04.2024	98.341	0,08
40.000	MetLife Inc	4,55 %	23.03.2030	39.099	0,03
50.000	MetLife Inc	6,50 %	15.12.2032	54.666	0,04
25.000	MetLife Inc	4,13 %	13.08.2042	20.945	0,02
100.000	MetLife Inc	4,05 %	01.03.2045	83.098	0,07
100.000	MetLife Inc '144A'	9,25 %	08.04.2038	116.313	0,09
150.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A'	3,45 %	18.12.2026	140.600	0,11
200.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A'	5,15 %	28.03.2033	196.699	0,16
75.000	Micron Technology Inc	6,75 %	01.11.2029	78.109	0,06
50.000	Microsoft Corp	3,63 %	15.12.2023	49.638	0,04

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
100.000	Microsoft Corp	2,70 %	12.02.2025	96.433	0,08
170.000	Microsoft Corp	2,40 %	08.08.2026	159.702	0,13
150.000	Microsoft Corp	3,30 %	06.02.2027	144.264	0,12
65.000	Microsoft Corp	4,20 %	03.11.2035	64.505	0,05
40.000	Microsoft Corp	3,45 %	08.08.2036	36.417	0,03
35.000	Microsoft Corp	4,10 %	06.02.2037	33.616	0,03
70.000	Microsoft Corp	3,50 %	15.11.2042	60.262	0,05
200.000	Microsoft Corp	2,53 %	01.06.2050	139.265	0,11
35.000	Microsoft Corp	2,92 %	17.03.2052	26.083	0,02
100.000	Microsoft Corp	2,68 %	01.06.2060	67.017	0,05
93.000	MidAmerican Energy Co	3,65 %	15.04.2029	86.394	0,07
40.000	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd '144A'	6,50 %	20.06.2027	40.200	0,03
90.000	Molson Coors Beverage Co	4,20 %	15.07.2046	73.884	0,06
70.000	Mondelez International Inc	1,50 %	04.05.2025	65.398	0,05
75.000	Moody's Corp	3,75 %	24.03.2025	72.887	0,06
100.000	Morgan Stanley	5,00 %	24.11.2025	98.407	0,08
50.000	Morgan Stanley	6,38 %	24.07.2042	56.024	0,05
50.000	Morgan Stanley	4,30 %	27.01.2045	43.270	0,04
70.000	Morgan Stanley	4,38 %	22.01.2047	62.451	0,05
100.000	Morgan Stanley FRN	0,79 %	30.05.2025	94.972	0,08
200.000	Morgan Stanley FRN	3,59 %	22.07.2028	184.966	0,15
200.000	Morgan Stanley FRN	6,34 %	18.10.2033	213.307	0,17
350.000	Morgan Stanley FRN	4,46 %	22.04.2039	310.052	0,25
100.000	Morgan Stanley 'GMTN'	3,70 %	23.10.2024	97.687	0,08
125.000	Morgan Stanley 'GMTN'	4,00 %	23.07.2025	121.478	0,10
40.000	Morgan Stanley 'GMTN'	3,88 %	27.01.2026	38.575	0,03
100.000	Morgan Stanley 'GMTN'	4,35 %	08.09.2026	96.740	0,08
200.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN	1,51 %	20.07.2027	177.445	0,14
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN	3,77 %	24.01.2029	93.516	0,08
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN	4,43 %	23.01.2030	95.271	0,08
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN	2,24 %	21.07.2032	79.414	0,06
50.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN	5,60 %	24.03.2051	52.192	0,04

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
175.000	Morgan Stanley 'MTN'	3,13 %	27.07.2026	163.918	0,13
100.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN	5,54 %	25.01.2024	99.792	0,08
325.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN	5,25 %	21.04.2034	320.893	0,26
400.000	Mosaic Co/The	5,45 %	15.11.2033	390.564	0,32
140.000	Motorola Solutions Inc	4,60 %	23.02.2028	135.780	0,11
75.000	MPLX LP	4,88 %	01.12.2024	73.898	0,06
160.000	MPLX LP	4,88 %	01.06.2025	157.139	0,13
75.000	MPLX LP	1,75 %	01.03.2026	67.943	0,06
75.000	MPLX LP	4,25 %	01.12.2027	71.399	0,06
150.000	MPLX LP	2,65 %	15.08.2030	125.358	0,10
110.000	MPLX LP	5,00 %	01.03.2033	105.427	0,09
50.000	MPLX LP	5,50 %	15.02.2049	45.573	0,04
50.000	MPLX LP	4,95 %	14.03.2052	42.510	0,03
75.000	Mylan Inc	4,55 %	15.04.2028	70.856	0,06
100.000	Nasdaq Inc	1,65 %	15.01.2031	77.807	0,06
5.000	Nasdaq Inc	5,95 %	15.08.2053	5.124	0,00
200.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp	4,80 %	15.03.2028	197.950	0,16
225.000	Nationwide Financial Services Inc '144A'	3,90 %	30.11.2049	163.488	0,13
200.000	Nationwide Mutual Insurance Co '144A'	4,35 %	30.04.2050	152.315	0,12
100.000	NBCUniversal Media LLC	4,45 %	15.01.2043	89.840	0,07
150.000	Nestle Holdings Inc '144A'	3,90 %	24.09.2038	135.214	0,11
25.000	New York and Presbyterian Hospital/The	4,02 %	01.08.2045	21.222	0,02
75.000	New York Life Global Funding '144A'	2,90 %	17.01.2024	73.887	0,06
50.000	New York Life Global Funding '144A'	1,85 %	01.08.2031	39.500	0,03
50.000	New York Life Insurance Co '144A'	5,88 %	15.05.2033	51.727	0,04
25.000	New York Life Insurance Co '144A'	6,75 %	15.11.2039	28.459	0,02
25.000	New York Life Insurance Co '144A'	4,45 %	15.05.2069	20.438	0,02
100.000	Newmont Corp	6,25 %	01.10.2039	105.573	0,09
50.000	Niagara Mohawk Power Corp '144A'	1,96 %	27.06.2030	40.044	0,03
200.000	NIKE Inc	3,25 %	27.03.2040	164.388	0,13
50.000	Nissan Motor Acceptance Co LLC '144A'	2,00 %	09.03.2026	43.768	0,04
50.000	Norfolk Southern Corp	3,80 %	01.08.2028	47.358	0,04

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
100.000	Norfolk Southern Corp	4,05 %	15.08.2052	82.446	0,07
275.000	Northern Trust Corp	1,95 %	01.05.2030	226.158	0,18
100.000	Northwell Healthcare Inc	3,98 %	01.11.2046	77.942	0,06
50.000	Northwestern Mutual Global Funding '144A'	4,90 %	12.06.2028	49.548	0,04
50.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A'	3,85 %	30.09.2047	39.008	0,03
30.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A'	3,63 %	30.09.2059	21.086	0,02
164.000	Novartis Capital Corp	1,75 %	14.02.2025	155.591	0,13
40.000	Novartis Capital Corp	2,00 %	14.02.2027	36.698	0,03
30.000	Novartis Capital Corp	2,75 %	14.08.2050	21.775	0,02
50.000	NSTAR Electric Co	3,20 %	15.05.2027	46.990	0,04
25.000	NVIDIA Corp	2,85 %	01.04.2030	22.658	0,02
100.000	NVIDIA Corp	3,50 %	01.04.2040	85.347	0,07
15.000	NVIDIA Corp	3,70 %	01.04.2060	12.384	0,01
100.000	Omega Healthcare Investors Inc	4,50 %	01.04.2027	92.928	0,08
100.000	Omega Healthcare Investors Inc	3,38 %	01.02.2031	79.100	0,06
30.000	Omnicom Group Inc / Omnicom Capital Inc	3,60 %	15.04.2026	28.792	0,02
100.000	Oncor Electric Delivery Co LLC	3,10 %	15.09.2049	71.260	0,06
40.000	ONEOK Inc	2,75 %	01.09.2024	38.511	0,03
100.000	ONEOK Inc	6,35 %	15.01.2031	103.088	0,08
50.000	ONEOK Inc	4,95 %	13.07.2047	41.174	0,03
40.000	ONEOK Partners LP	6,13 %	01.02.2041	38.574	0,03
50.000	Oracle Corp	2,40 %	15.09.2023	49.673	0,04
75.000	Oracle Corp	2,50 %	01.04.2025	71.207	0,06
100.000	Oracle Corp	2,95 %	15.05.2025	95.428	0,08
100.000	Oracle Corp	2,65 %	15.07.2026	92.471	0,08
100.000	Oracle Corp	2,80 %	01.04.2027	92.057	0,08
50.000	Oracle Corp	2,88 %	25.03.2031	42.709	0,03
300.000	Oracle Corp	4,90 %	06.02.2033	291.247	0,24
82.000	Oracle Corp	3,90 %	15.05.2035	70.701	0,06
250.000	Oracle Corp	3,80 %	15.11.2037	204.709	0,17
200.000	Oracle Corp	4,13 %	15.05.2045	157.288	0,13
87.000	Oracle Corp	4,00 %	15.07.2046	67.119	0,05

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
108.000	Oracle Corp	3,60 %	01.04.2050	76.884	0,06
40.000	Oracle Corp	3,95 %	25.03.2051	30.139	0,02
30.000	Oracle Corp	4,10 %	25.03.2061	22.275	0,02
10.000	O'Reilly Automotive Inc	4,20 %	01.04.2030	9.444	0,01
25.000	O'Reilly Automotive Inc	1,75 %	15.03.2031	19.743	0,02
50.000	Otis Worldwide Corp	2,06 %	05.04.2025	47.146	0,04
100.000	Otis Worldwide Corp	3,11 %	15.02.2040	77.530	0,06
60.000	Ovintiv Inc	6,25 %	15.07.2033	59.242	0,05
25.000	Pacific LifeCorp '144A'	3,35 %	15.09.2050	17.304	0,01
200.000	Paramount Global	4,85 %	01.07.2042	148.949	0,12
58.000	Paramount Global	5,85 %	01.09.2043	49.180	0,04
150.000	Paramount Global	4,90 %	15.08.2044	111.397	0,09
50.000	Parker-Hannifin Corp	3,65 %	15.06.2024	49.022	0,04
100.000	Parker-Hannifin Corp	4,25 %	15.09.2027	96.927	0,08
10.000	Parker-Hannifin Corp	4,50 %	15.09.2029	9.703	0,01
50.000	PayPal Holdings Inc	2,40 %	01.10.2024	48.058	0,04
75.000	PayPal Holdings Inc	2,30 %	01.06.2030	63.611	0,05
50.000	PECO Energy Co	4,90 %	15.06.2033	49.783	0,04
70.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A'	5,75 %	24.05.2026	69.278	0,06
25.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A'	4,20 %	01.04.2027	23.465	0,02
50.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A'	5,55 %	01.05.2028	49.350	0,04
100.000	PepsiCo Inc	3,60 %	01.03.2024	98.719	0,08
50.000	PepsiCo Inc	2,38 %	06.10.2026	46.910	0,04
200.000	PepsiCo Inc	2,63 %	29.07.2029	180.306	0,15
200.000	PepsiCo Inc	2,75 %	19.03.2030	179.955	0,15
100.000	PepsiCo Inc	4,45 %	15.02.2033	100.481	0,08
50.000	PepsiCo Inc	2,75 %	21.10.2051	36.055	0,03
100.000	Revvity Inc	3,30 %	15.09.2029	88.866	0,07
30.000	Pfizer Inc	2,75 %	03.06.2026	28.351	0,02
70.000	Pfizer Inc	3,00 %	15.12.2026	66.036	0,05
80.000	Pfizer Inc	2,63 %	01.04.2030	71.219	0,06
100.000	Pfizer Inc	2,55 %	28.05.2040	73.761	0,06

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
20.000	Pfizer Inc	4,13 %	15.12.2046	17.820	0,01
50.000	Pfizer Inc	4,20 %	15.09.2048	46.237	0,04
182.000	Phillips 66	3,90 %	15.03.2028	172.384	0,14
40.000	Phillips 66 Co	3,55 %	01.10.2026	37.541	0,03
100.000	Phillips 66 Co	3,75 %	01.03.2028	93.548	0,08
100.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp	3,80 %	15.09.2030	88.693	0,07
100.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp	4,70 %	15.06.2044	78.161	0,06
100.000	PNC Financial Services Group Inc/The	2,60 %	23.07.2026	92.097	0,08
112.000	PNC Financial Services Group Inc/The	2,55 %	22.01.2030	94.494	0,08
150.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN	5,35 %	02.12.2028	148.392	0,12
167.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN	5,58 %	12.06.2029	166.416	0,14
150.000	PNC Financial Services Group Inc/The FRN	6,04 %	28.10.2033	153.851	0,13
25.000	President and Fellows of Harvard College	2,52 %	15.10.2050	16.913	0,01
52.000	Principal Financial Group Inc	3,70 %	15.05.2029	47.637	0,04
250.000	Principal Life Global Funding II '144A'	3,00 %	18.04.2026	231.786	0,19
25.000	Procter & Gamble Co/The	3,95 %	26.01.2028	24.593	0,02
50.000	Procter & Gamble Co/The	3,00 %	25.03.2030	46.342	0,04
40.000	Procter & Gamble Co/The	3,55 %	25.03.2040	35.437	0,03
50.000	Progressive Corp/The	4,20 %	15.03.2048	43.099	0,04
50.000	Progressive Corp/The	3,70 %	15.03.2052	39.141	0,03
100.000	Prologis LP	1,25 %	15.10.2030	77.545	0,06
100.000	Prologis LP	2,13 %	15.10.2050	56.356	0,05
109.000	Prudential Financial Inc	3,94 %	07.12.2049	86.527	0,07
200.000	Prudential Financial Inc 'MTN'	4,60 %	15.05.2044	177.177	0,14
71.000	Public Service Co of Colorado	3,20 %	01.03.2050	50.154	0,04
50.000	Public Service Electric and Gas Co 'MTN'	4,65 %	15.03.2033	49.100	0,04
200.000	Public Storage	1,95 %	09.11.2028	171.714	0,14
50.000	Public Storage	2,25 %	09.11.2031	40.880	0,03
100.000	Qorvo Inc	4,38 %	15.10.2029	90.375	0,07
75.000	QUALCOMM Inc	2,90 %	20.05.2024	73.357	0,06
75.000	QUALCOMM Inc	3,25 %	20.05.2027	71.101	0,06
40.000	QUALCOMM Inc	4,65 %	20.05.2035	39.783	0,03

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
40.000	QUALCOMM Inc	4,80 %	20.05.2045	38.726	0,03
25.000	QUALCOMM Inc	3,25 %	20.05.2050	18.834	0,02
150.000	Quanta Services Inc	3,05 %	01.10.2041	104.219	0,09
125.000	Ralph Lauren Corp	2,95 %	15.06.2030	110.482	0,09
100.000	Raymond James Financial Inc	4,65 %	01.04.2030	97.090	0,08
100.000	Realty Income Corp	4,88 %	01.06.2026	98.866	0,08
174.000	Realty Income Corp	3,25 %	15.06.2029	155.701	0,13
10.000	Regal Rexnord Corp '144A'	6,05 %	15.02.2026	10.008	0,01
10.000	Regal Rexnord Corp '144A'	6,05 %	15.04.2028	9.950	0,01
60.000	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1,75 %	15.09.2030	48.024	0,04
75.000	Regions Financial Corp	2,25 %	18.05.2025	68.893	0,06
71.000	RELX Capital Inc	4,00 %	18.03.2029	67.812	0,06
100.000	Republic Services Inc	2,30 %	01.03.2030	85.436	0,07
140.000	Republic Services Inc	1,75 %	15.02.2032	109.688	0,09
100.000	Roche Holdings Inc '144A'	7,00 %	01.03.2039	121.131	0,10
100.000	Rockwell Automation Inc	4,20 %	01.03.2049	89.552	0,07
40.000	Roper Technologies Inc	3,80 %	15.12.2026	38.278	0,03
85.000	Roper Technologies Inc	2,95 %	15.09.2029	75.018	0,06
25.000	Ross Stores Inc	4,60 %	15.04.2025	24.570	0,02
159.000	Ryder System Inc 'MTN'	2,50 %	01.09.2024	152.766	0,12
50.000	S&P Global Inc	4,25 %	01.05.2029	48.655	0,04
100.000	S&P Global Inc	2,90 %	01.03.2032	86.592	0,07
40.000	S&P Global Inc	3,25 %	01.12.2049	30.135	0,02
20.000	S&P Global Inc	2,30 %	15.08.2060	11.653	0,01
42.000	Sabine Pass Liquefaction LLC	5,63 %	01.03.2025	41.812	0,03
75.000	Sabine Pass Liquefaction LLC	5,00 %	15.03.2027	73.820	0,06
200.000	Sabine Pass Liquefaction LLC	4,20 %	15.03.2028	189.524	0,15
20.000	Sabra Health Care LP	5,13 %	15.08.2026	18.898	0,02
100.000	Salesforce Inc	1,50 %	15.07.2028	86.080	0,07
130.000	Salesforce Inc	2,90 %	15.07.2051	91.754	0,07
300.000	Sammons Financial Group Inc '144A'	3,35 %	16.04.2031	231.123	0,19
10.000	San Diego Gas & Electric Co	2,50 %	15.05.2026	9.347	0,01

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
50.000	San Diego Gas & Electric Co	1,70 %	01.10.2030	40.116	0,03
45.000	Santander Holdings USA Inc	3,50 %	07.06.2024	43.716	0,04
100.000	Santander Holdings USA Inc	4,50 %	17.07.2025	96.946	0,08
25.000	Santander Holdings USA Inc	4,40 %	13.07.2027	23.527	0,02
250.000	SC Johnson & Son Inc '144A'	4,80 %	01.09.2040	229.935	0,19
75.000	Schlumberger Holdings Corp '144A'	3,90 %	17.05.2028	70.688	0,06
110.000	Sempra	5,40 %	01.08.2026	109.560	0,09
100.000	Sempra	3,25 %	15.06.2027	92.451	0,08
100.000	Sempra	3,80 %	01.02.2038	82.670	0,07
25.000	SES GLOBAL Americas Holdings Inc '144A'	5,30 %	25.03.2044	18.259	0,01
40.000	Sherwin-Williams Co/The	3,80 %	15.08.2049	30.822	0,03
125.000	Simon Property Group LP	3,50 %	01.09.2025	119.859	0,10
50.000	Simon Property Group LP	3,38 %	15.06.2027	46.486	0,04
50.000	Simon Property Group LP	2,65 %	15.07.2030	42.536	0,03
20.000	Simon Property Group LP	3,25 %	13.09.2049	13.518	0,01
100.000	Smithfield Foods Inc '144A'	4,25 %	01.02.2027	92.586	0,08
200.000	Smithfield Foods Inc '144A'	3,00 %	15.10.2030	157.522	0,13
100.000	Snap-on Inc	3,10 %	01.05.2050	74.140	0,06
75.000	Sonoco Products Co	2,85 %	01.02.2032	62.394	0,05
50.000	Southern California Edison Co	3,70 %	01.08.2025	48.017	0,04
40.000	Southern California Edison Co	4,70 %	01.06.2027	39.347	0,03
150.000	Southern California Edison Co	4,13 %	01.03.2048	121.414	0,10
50.000	Southern California Edison Co	4,88 %	01.03.2049	44.962	0,04
50.000	Southern California Edison Co	3,65 %	01.02.2050	37.366	0,03
50.000	Southern California Edison Co	5,88 %	01.12.2053	50.357	0,04
100.000	Southern California Gas Co	4,30 %	15.01.2049	83.994	0,07
200.000	Southern Natural Gas Co LLC '144A'	4,80 %	15.03.2047	168.743	0,14
80.000	Southern Power Co	4,15 %	01.12.2025	78.288	0,06
100.000	Southwest Airlines Co	5,13 %	15.06.2027	99.416	0,08
70.000	Sprint Capital Corp	8,75 %	15.03.2032	84.839	0,07
100.000	Sprint LLC	7,63 %	01.03.2026	103.877	0,08
50.000	Stanley Black & Decker Inc	2,30 %	15.03.2030	41.221	0,03

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
50.000	Stanley Black & Decker Inc	2,75 %	15.11.2050	29.824	0,02
100.000	Starbucks Corp	3,50 %	01.03.2028	93.830	0,08
15.000	Starbucks Corp	4,50 %	15.11.2048	13.446	0,01
25.000	Starbucks Corp	3,50 %	15.11.2050	19.004	0,02
100.000	State Street Corp FRN	4,14 %	03.12.2029	95.179	0,08
150.000	State Street Corp FRN	4,16 %	04.08.2033	139.047	0,11
75.000	State Street Corp FRN	4,82 %	26.01.2034	72.964	0,06
100.000	Stryker Corp	0,60 %	01.12.2023	97.944	0,08
100.000	Synchrony Financial	4,50 %	23.07.2025	94.549	0,08
100.000	Synchrony Financial	3,70 %	04.08.2026	89.542	0,07
100.000	Sysco Corp	3,30 %	15.07.2026	94.479	0,08
140.000	Sysco Corp	2,40 %	15.02.2030	119.530	0,10
25.000	Sysco Corp	4,85 %	01.10.2045	22.341	0,02
39.000	Sysco Corp	4,45 %	15.03.2048	33.545	0,03
30.000	Sysco Corp	6,60 %	01.04.2050	34.140	0,03
70.000	Targa Resources Corp	6,25 %	01.07.2052	68.447	0,06
40.000	Target Corp	2,35 %	15.02.2030	34.750	0,03
50.000	Target Corp	4,40 %	15.01.2033	48.713	0,04
46.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America '144A'	4,27 %	15.05.2047	38.142	0,03
25.000	Texas Instruments Inc	1,38 %	12.03.2025	23.484	0,02
75.000	Texas Instruments Inc	2,25 %	04.09.2029	65.482	0,05
75.000	Texas Instruments Inc	4,90 %	14.03.2033	76.723	0,06
40.000	Texas Instruments Inc	4,15 %	15.05.2048	36.381	0,03
50.000	Thermo Fisher Scientific Inc	1,22 %	18.10.2024	47.287	0,04
75.000	Time Warner Cable LLC	5,50 %	01.09.2041	62.648	0,05
100.000	Time Warner Cable LLC	4,50 %	15.09.2042	74.879	0,06
100.000	TJX Cos Inc/The	1,60 %	15.05.2031	81.331	0,07
50.000	T-Mobile USA Inc	3,50 %	15.04.2025	48.110	0,04
50.000	T-Mobile USA Inc	3,75 %	15.04.2027	47.395	0,04
10.000	T-Mobile USA Inc	2,05 %	15.02.2028	8.684	0,01
100.000	T-Mobile USA Inc	2,40 %	15.03.2029	85.932	0,07
100.000	T-Mobile USA Inc	3,88 %	15.04.2030	92.130	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
40.000	T-Mobile USA Inc	2,25 %	15.11.2031	32.106	0,03
275.000	T-Mobile USA Inc	5,20 %	15.01.2033	273.235	0,22
25.000	T-Mobile USA Inc	4,50 %	15.04.2050	21.523	0,02
100.000	T-Mobile USA Inc	3,30 %	15.02.2051	70.284	0,06
75.000	T-Mobile USA Inc	3,60 %	15.11.2060	52.723	0,04
357.000	Toyota Motor Credit Corp	5,45 %	10.11.2027	364.601	0,30
10.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN'	3,00 %	01.04.2025	9.641	0,01
100.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN'	0,80 %	16.10.2025	90.902	0,07
200.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN'	1,90 %	06.04.2028	175.596	0,14
40.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN'	2,15 %	13.02.2030	34.249	0,03
150.000	Tractor Supply Co	1,75 %	01.11.2030	118.214	0,10
150.000	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC	4,60 %	15.03.2048	127.727	0,10
122.000	Travelers Cos Inc/The	4,00 %	30.05.2047	103.311	0,08
75.000	Truist Bank	3,20 %	01.04.2024	73.513	0,06
100.000	Truist Bank 'BKNT'	4,05 %	03.11.2025	95.702	0,08
50.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN	5,90 %	28.10.2026	49.637	0,04
50.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN	1,27 %	02.03.2027	44.139	0,04
300.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN	4,87 %	26.01.2029	288.489	0,24
150.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN	1,89 %	07.06.2029	124.610	0,10
50.000	TWDC Enterprises 18 Corp 'GMTN'	4,13 %	01.06.2044	43.881	0,04
100.000	TWDC Enterprises 18 Corp 'MTN'	1,85 %	30.07.2026	91.249	0,07
100.000	TWDC Enterprises 18 Corp 'MTN'	2,95 %	15.06.2027	93.546	0,08
152.000	Unilever Capital Corp	3,10 %	30.07.2025	145.791	0,12
30.000	Unilever Capital Corp	5,90 %	15.11.2032	32.866	0,03
100.000	Union Pacific Corp	2,40 %	05.02.2030	86.946	0,07
50.000	Union Pacific Corp	2,38 %	20.05.2031	42.394	0,03
300.000	Union Pacific Corp	4,00 %	15.04.2047	254.435	0,21
70.000	Union Pacific Corp	3,84 %	20.03.2060	55.582	0,05
75.000	United Parcel Service Inc	3,90 %	01.04.2025	73.441	0,06
10.000	United Parcel Service Inc	3,05 %	15.11.2027	9.418	0,01
35.000	United Parcel Service Inc	4,45 %	01.04.2030	34.948	0,03
50.000	United Parcel Service Inc	3,40 %	15.11.2046	38.993	0,03

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
30.000	United Parcel Service Inc	3,40 %	01.09.2049	23.874	0,02
50.000	United Rentals North America Inc '144A'	6,00 %	15.12.2029	49.925	0,04
50.000	UnitedHealth Group Inc	2,38 %	15.08.2024	48.288	0,04
50.000	UnitedHealth Group Inc	3,45 %	15.01.2027	47.461	0,04
75.000	UnitedHealth Group Inc	3,85 %	15.06.2028	71.934	0,06
150.000	UnitedHealth Group Inc	2,00 %	15.05.2030	126.186	0,10
150.000	UnitedHealth Group Inc	4,50 %	15.04.2033	145.793	0,12
50.000	UnitedHealth Group Inc	6,88 %	15.02.2038	58.550	0,05
150.000	UnitedHealth Group Inc	3,95 %	15.10.2042	129.848	0,11
135.000	UnitedHealth Group Inc	4,75 %	15.07.2045	128.957	0,11
10.000	UnitedHealth Group Inc	4,20 %	15.01.2047	8.836	0,01
40.000	UnitedHealth Group Inc	4,25 %	15.04.2047	35.594	0,03
44.000	UnitedHealth Group Inc	3,75 %	15.10.2047	36.043	0,03
125.000	UnitedHealth Group Inc	3,88 %	15.08.2059	102.085	0,08
50.000	US Bancorp	2,40 %	30.07.2024	48.186	0,04
100.000	US Bancorp	1,45 %	12.05.2025	93.215	0,08
91.000	US Bancorp	3,00 %	30.07.2029	76.796	0,06
150.000	US Bancorp FRN	5,85 %	21.10.2033	150.551	0,12
200.000	US Bancorp 'MTN'	3,10 %	27.04.2026	187.031	0,15
150.000	US Bancorp 'MTN'	3,90 %	26.04.2028	140.486	0,11
100.000	US Bancorp 'MTN' FRN	4,97 %	22.07.2033	90.538	0,07
24.000	Ventas Realty LP	4,75 %	15.11.2030	22.775	0,02
200.000	Verisk Analytics Inc	3,63 %	15.05.2050	146.569	0,12
75.000	Verizon Communications Inc	3,38 %	15.02.2025	72.507	0,06
125.000	Verizon Communications Inc	4,13 %	16.03.2027	121.479	0,10
100.000	Verizon Communications Inc	3,00 %	22.03.2027	93.388	0,08
100.000	Verizon Communications Inc	4,02 %	03.12.2029	93.452	0,08
100.000	Verizon Communications Inc	1,68 %	30.10.2030	79.410	0,06
100.000	Verizon Communications Inc	1,75 %	20.01.2031	78.877	0,06
20.000	Verizon Communications Inc	2,36 %	15.03.2032	16.126	0,01
154.000	Verizon Communications Inc	2,36 %	15.03.2032	124.167	0,10
100.000	Verizon Communications Inc	5,05 %	09.05.2033	98.787	0,08

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
80.000	Verizon Communications Inc	4,27 %	15.01.2036	72.194	0,06
100.000	Verizon Communications Inc	2,65 %	20.11.2040	69.373	0,06
70.000	Verizon Communications Inc	3,40 %	22.03.2041	54.153	0,04
50.000	Verizon Communications Inc	4,86 %	21.08.2046	45.785	0,04
50.000	Verizon Communications Inc	4,00 %	22.03.2050	40.503	0,03
83.000	Verizon Communications Inc	2,88 %	20.11.2050	53.991	0,04
120.000	Verizon Communications Inc	3,55 %	22.03.2051	90.120	0,07
100.000	Verizon Communications Inc	3,88 %	01.03.2052	78.442	0,06
50.000	Verizon Communications Inc	2,99 %	30.10.2056	32.013	0,03
65.000	Verizon Communications Inc	3,00 %	20.11.2060	40.631	0,03
48.000	Verizon Communications Inc	3,70 %	22.03.2061	34.927	0,03
30.000	Verizon Communications Inc FRN	5,88 %	20.03.2026	30.050	0,02
28.000	VF Corp	2,95 %	23.04.2030	23.058	0,02
100.000	Viatis Inc	4,00 %	22.06.2050	66.133	0,05
50.000	VICI Properties LP	4,95 %	15.02.2030	46.990	0,04
120.000	VICI Properties LP	5,13 %	15.05.2032	112.084	0,09
300.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A'	4,25 %	01.12.2026	281.349	0,23
100.000	Visa Inc	3,15 %	14.12.2025	95.975	0,08
75.000	Visa Inc	2,05 %	15.04.2030	64.319	0,05
200.000	Visa Inc	4,15 %	14.12.2035	191.192	0,16
45.000	Visa Inc	2,70 %	15.04.2040	34.648	0,03
100.000	Visa Inc	2,00 %	15.08.2050	61.377	0,05
100.000	VMware Inc	1,00 %	15.08.2024	94.683	0,08
102.000	VMware Inc	3,90 %	21.08.2027	96.871	0,08
200.000	Vontier Corp	1,80 %	01.04.2026	178.578	0,15
10.000	Vontier Corp	2,95 %	01.04.2031	7.948	0,01
25.000	Vulcan Materials Co	3,50 %	01.06.2030	22.619	0,02
20.000	Walmart Inc	3,90 %	09.09.2025	19.594	0,02
20.000	Walmart Inc	1,50 %	22.09.2028	17.377	0,01
70.000	Walmart Inc	3,25 %	08.07.2029	65.530	0,05
100.000	Walmart Inc	4,15 %	09.09.2032	98.701	0,08
70.000	Walmart Inc	3,95 %	28.06.2038	64.858	0,05

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
150.000	Walmart Inc	5,63 %	01.04.2040	163.572	0,13
100.000	Walt Disney Co/The	1,75 %	13.01.2026	92.575	0,08
80.000	Walt Disney Co/The	2,00 %	01.09.2029	67.968	0,06
100.000	Walt Disney Co/The	3,80 %	22.03.2030	94.633	0,08
10.000	Walt Disney Co/The	2,65 %	13.01.2031	8.695	0,01
133.000	Walt Disney Co/The	6,40 %	15.12.2035	149.338	0,12
110.000	Walt Disney Co/The	6,65 %	15.11.2037	126.717	0,10
50.000	Walt Disney Co/The	4,75 %	15.09.2044	47.316	0,04
50.000	Walt Disney Co/The	2,75 %	01.09.2049	33.982	0,03
100.000	Walt Disney Co/The	3,60 %	13.01.2051	79.468	0,06
40.000	Walt Disney Co/The	3,80 %	13.05.2060	32.095	0,03
75.000	Warnermedia Holdings Inc	3,43 %	15.03.2024	73.669	0,06
100.000	Warnermedia Holdings Inc	3,76 %	15.03.2027	93.340	0,08
100.000	Warnermedia Holdings Inc	4,28 %	15.03.2032	88.451	0,07
100.000	Warnermedia Holdings Inc	5,14 %	15.03.2052	81.314	0,07
10.000	Warnermedia Holdings Inc	5,39 %	15.03.2062	8.128	0,01
50.000	Waste Management Inc	3,13 %	01.03.2025	48.194	0,04
30.000	WEA Finance LLC '144A'	4,63 %	20.09.2048	21.293	0,02
40.000	Wells Fargo & Co	5,38 %	02.11.2043	37.803	0,03
100.000	Wells Fargo & Co FRN	2,19 %	30.04.2026	93.795	0,08
50.000	Wells Fargo & Co FRN	3,07 %	30.04.2041	36.877	0,03
100.000	Wells Fargo & Co 'MTN'	3,75 %	24.01.2024	98.837	0,08
100.000	Wells Fargo & Co 'MTN'	4,15 %	24.01.2029	94.624	0,08
30.000	Wells Fargo & Co 'MTN'	4,65 %	04.11.2044	25.457	0,02
75.000	Wells Fargo & Co 'MTN'	4,40 %	14.06.2046	60.965	0,05
125.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN	2,16 %	11.02.2026	117.744	0,10
125.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN	3,58 %	22.05.2028	116.566	0,10
25.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN	4,48 %	04.04.2031	23.812	0,02
150.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN	3,35 %	02.03.2033	128.025	0,10
30.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN	5,01 %	04.04.2051	28.084	0,02
80.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN	4,61 %	25.04.2053	70.619	0,06
158.000	Welltower OP LLC	3,63 %	15.03.2024	155.245	0,13

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,57 %) (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 75,24 %) (Fortsetzung)					
350.000	Welltower OP LLC	4,13 %	15.03.2029	324.483	0,27
25.000	Western & Southern Life Insurance Co/The '144A'	5,15 %	15.01.2049	22.730	0,02
75.000	Western Midstream Operating LP	6,15 %	01.04.2033	74.981	0,06
40.000	Western Union Co/The	1,35 %	15.03.2026	35.414	0,03
50.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	4,95 %	15.09.2028	48.226	0,04
100.000	Whirlpool Corp	4,75 %	26.02.2029	97.382	0,08
50.000	Whirlpool Corp	4,50 %	01.06.2046	40.836	0,03
50.000	Williams Cos Inc/The	4,55 %	24.06.2024	49.339	0,04
259.000	Williams Cos Inc/The	5,40 %	04.03.2044	239.080	0,20
70.000	Williams Cos Inc/The	4,85 %	01.03.2048	60.992	0,05
100.000	WRKCo Inc	3,90 %	01.06.2028	93.359	0,08
30.000	Wyeth LLC	5,95 %	01.04.2037	32.742	0,03
50.000	Xilinx Inc	2,38 %	01.06.2030	43.269	0,04
100.000	Xylem Inc/NY	1,95 %	30.01.2028	87.775	0,07
250.000	Zions Bancorp NA	3,25 %	29.10.2029	184.770	0,15
26.000	Zoetis Inc	3,95 %	12.09.2047	21.368	0,02
25.000	Zoetis Inc	3,00 %	15.05.2050	17.367	0,01
Vereinigte Staaten insgesamt				93.240.053	76,27
Unternehmensanleihen insgesamt				120.871.795	98,88
Gesamtanlagen					
Unternehmensanleihen				120.871.795	98,88
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten*				1.375.249	1,12
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen				122.247.044	100,00

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	98,87
Sonstige Vermögenswerte	1,13
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

*In den sonstigen Vermögenswerten sind Anteile am LGIM Dollar Liquidity Fund mit einem Wert von 102.572 US\$ enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %)					
Argentinien (30. Juni 2022: 0,92 %)					
230.000	MSU Energy SA / UGEN SA / UENSA SA 'REGS'	6,88 %	01.02.2025	159.879	0,02
1.000.000	Pampa Energia SA 'REGS'	7,50 %	24.01.2027	941.470	0,13
520.000	YPF SA 'REGS'	8,75 %	04.04.2024	501.628	0,07
1.000.000	YPF SA 'REGS'	8,50 %	28.07.2025	907.810	0,13
50.000	YPF SA 'REGS'	6,95 %	21.07.2027	40.500	0,01
200.000	YPF SA 'REGS'	7,00 %	15.12.2047	136.116	0,02
846.154	YPF SA Step-Up Coupon 'REGS'	9,00 %	12.02.2026	841.923	0,12
800.000	YPF SA Step-Up Coupon 'REGS'	9,00 %	30.06.2029	718.360	0,10
650.000	YPF SA Step-Up Coupon 'REGS'	7,00 %	30.09.2033	480.643	0,07
Argentinien insgesamt				4.728.329	0,67
Österreich (30. Juni 2022: 1,17 %)					
1.100.000	Klabin Austria GmbH 'REGS'	5,75 %	03.04.2029	1.080.519	0,15
1.750.000	Klabin Austria GmbH 'REGS'	3,20 %	12.01.2031	1.399.125	0,20
1.000.000	Klabin Austria GmbH 'REGS'	7,00 %	03.04.2049	958.250	0,14
1.269.000	Suzano Austria GmbH	2,50 %	15.09.2028	1.077.216	0,15
727.000	Suzano Austria GmbH	5,00 %	15.01.2030	678.487	0,10
1.605.000	Suzano Austria GmbH	3,75 %	15.01.2031	1.361.521	0,19
910.000	Suzano Austria GmbH	3,13 %	15.01.2032	725.225	0,10
643.000	Suzano Austria GmbH 'REGS'	5,75 %	14.07.2026	643.939	0,09
1.600.000	Suzano Austria GmbH 'REGS'	7,00 %	16.03.2047	1.607.712	0,23
Österreich insgesamt				9.531.994	1,35
Aserbaidshon (30. Juni 2022: 0,06 %)					
1.025.000	International Bank of Azerbaijan OJSC 'REGS'	3,50 %	01.09.2024	966.882	0,14
Aserbaidshon insgesamt				966.882	0,14
Bahamas (30. Juni 2022: 0,31 %)					
975.000	Competition Team Technologies Ltd	3,75 %	12.03.2024	958.766	0,14
Bahamas insgesamt				958.766	0,14

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Bermuda (30. Juni 2022: 1,74 %)					
400.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN'	2,00 %	15.09.2025	370.872	0,05
600.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN'	2,00 %	12.05.2026	546.066	0,08
1.266.000	Credicorp Ltd 'REGS'	2,75 %	17.06.2025	1.195.674	0,17
250.000	Geopark Ltd 'REGS'	5,50 %	17.01.2027	204.667	0,03
800.000	Haitong International Securities Group Ltd	3,38 %	19.07.2024	771.536	0,11
600.000	Investment Energy Resources Ltd 'REGS'	6,25 %	26.04.2029	556.754	0,08
200.000	Kunlun Energy Co Ltd 'REGS'	3,75 %	13.05.2025	193.342	0,03
1.050.000	Li & Fung Ltd 'EMTN' (Perpetual)	5,25 %	03.11.2023	515.298	0,07
800.000	Sagicor Financial Co Ltd 'REGS'	5,30 %	13.05.2028	753.240	0,11
250.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 'REGS'	4,85 %	14.10.2038	225.500	0,03
750.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS'	2,63 %	15.08.2025	680.948	0,10
1.100.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS'	4,00 %	15.08.2026	996.666	0,14
950.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS'	3,25 %	15.08.2030	724.309	0,10
Bermuda insgesamt				7.734.872	1,10
Brasilien (30. Juni 2022: 3,34 %)					
700.000	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao 'REGS'	4,13 %	20.09.2031	596.764	0,08
1.200.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS'	4,50 %	10.01.2025	1.159.200	0,16
550.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS'	2,75 %	11.01.2026	502.145	0,07
850.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS' FRN	7,75 %	15.02.2029	849.957	0,12
1.120.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	4,75 %	20.03.2024	1.103.995	0,16
1.900.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	4,63 %	15.01.2025	1.851.588	0,26
750.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	3,25 %	30.09.2026	691.905	0,10
750.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	4,88 %	11.01.2029	707.175	0,10
1.000.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	6,25 %	18.04.2030	994.000	0,14
1.550.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)	6,25 %	15.04.2024	1.381.577	0,20
1.975.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)	9,00 %	18.06.2024	1.979.246	0,28
1.140.000	BRF SA 'REGS'	5,75 %	21.09.2050	755.621	0,11
850.000	Cemig Geracao e Transmissao SA 'REGS'	9,25 %	05.12.2024	855.058	0,12
400.000	Cosan SA 'REGS'	5,50 %	20.09.2029	362.760	0,05
850.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS'	3,25 %	24.01.2025	815.439	0,12

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Brasilien (30. Juni 2022: 3,34 %) (Fortsetzung)					
800.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN	4,50 %	21.11.2029	770.000	0,11
500.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN	3,88 %	15.04.2031	457.525	0,06
1.500.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN (Perpetual)	7,72 %	12.12.2023	1.446.675	0,21
1.250.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN (Perpetual)	7,86 %	19.09.2023	1.213.787	0,17
600.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN (Perpetual)	4,63 %	27.02.2025	465.828	0,07
325.000	Natura Cosméticos SA 'REGS'	4,13 %	03.05.2028	281.161	0,04
Brasilien insgesamt				19.241.406	2,73
Britische Jungferninseln (30. Juni 2022: 6,21 %)					
500.000	Beijing Gas Singapore Capital Corp 'EMTN'	1,88 %	18.01.2025	470.530	0,07
400.000	Bluestar Finance Holdings Ltd	3,38 %	16.07.2024	388.796	0,05
600.000	BOCOM International Blossom Ltd 'EMTN'	1,75 %	28.06.2026	534.486	0,07
1.350.000	CAS Capital No 1 Ltd FRN (Perpetual)	4,00 %	12.07.2026	1.109.524	0,16
2.192.000	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 'REGS'	5,25 %	27.04.2029	2.024.356	0,29
700.000	Champion Path Holdings Ltd	4,50 %	27.01.2026	613.431	0,09
623.000	Champion Path Holdings Ltd	4,85 %	27.01.2028	504.755	0,07
200.000	China Cinda 2020 I Management Ltd 'EMTN'	1,25 %	20.01.2024	194.630	0,03
750.000	China Cinda 2020 I Management Ltd 'EMTN'	2,50 %	18.03.2025	702.533	0,10
700.000	China Cinda Finance 2014 Ltd 'REGS'	5,63 %	14.05.2024	695.730	0,10
200.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 'EMTN'	4,10 %	09.03.2024	197.014	0,03
650.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 'EMTN'	4,40 %	09.03.2027	619.775	0,09
250.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 'EMTN'	4,75 %	08.02.2028	239.222	0,03
200.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 'EMTN'	4,75 %	21.02.2029	188.800	0,03
200.000	CITIC Securities Finance MTN Co Ltd 'EMTN'	2,00 %	03.06.2025	186.288	0,03
700.000	CMHI Finance BVI Co Ltd	4,38 %	06.08.2023	698.964	0,10
200.000	CMHI Finance BVI Co Ltd FRN (Perpetual)	3,50 %	09.10.2023	198.432	0,03
200.000	CMS International Gemstone Ltd 'EMTN'	1,30 %	16.09.2024	188.480	0,03
600.000	CNCBINV 1 BVI Ltd	1,75 %	17.11.2024	565.014	0,08
2.280.000	Easy Tactic Ltd	7,50 %	11.07.2027	171.730	0,02
750.000	Elect Global Investments Ltd FRN (Perpetual)	4,10 %	03.06.2025	670.530	0,09
240.000	Franshion Brilliant Ltd	3,20 %	09.04.2026	211.222	0,03

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Britische Jungferninseln (30. Juni 2022: 6,21 %) (Fortsetzung)					
200.000	Fuqing Investment Management Ltd 'EMTN'	3,25 %	23.06.2025	168.836	0,02
850.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd 'REGS'	5,13 %	15.05.2024	841.007	0,12
350.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd 'REGS'	6,13 %	15.05.2029	353.528	0,05
200.000	Haitong International Finance Holdings 2015 Ltd	2,11 %	12.03.2025	186.926	0,03
350.000	Henderson Land MTN Ltd 'EMTN'	2,38 %	27.05.2025	327.533	0,05
600.000	HKT Capital No 2 Ltd	3,63 %	02.04.2025	577.932	0,08
950.000	HKT Capital No 4 Ltd	3,00 %	14.07.2026	877.116	0,12
310.000	HKT Capital No 5 Ltd	3,25 %	30.09.2029	273.076	0,04
900.000	HKT Capital No 6 Ltd	3,00 %	18.01.2032	757.440	0,11
300.000	Horse Gallop Finance Ltd 'EMTN'	1,10 %	26.07.2024	285.654	0,04
200.000	Horse Gallop Finance Ltd 'EMTN'	1,70 %	28.07.2025	183.512	0,03
200.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd	4,75 %	27.04.2027	172.266	0,02
200.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd 'EMTN'	4,25 %	07.11.2027	166.252	0,02
200.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd 'EMTN'	4,95 %	07.11.2047	133.316	0,02
200.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	2,13 %	30.09.2023	197.024	0,03
550.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	3,75 %	29.05.2024	527.351	0,07
200.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	3,25 %	13.11.2024	186.966	0,03
300.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	4,50 %	29.05.2029	239.349	0,03
250.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	3,38 %	24.02.2030	188.850	0,03
200.000	Huarong Finance II Co Ltd 'EMTN'	5,50 %	16.01.2025	189.476	0,03
200.000	Huarong Finance II Co Ltd 'EMTN'	5,00 %	19.11.2025	184.010	0,03
232.000	Huarong Finance II Co Ltd 'EMTN'	4,63 %	03.06.2026	205.849	0,03
378.000	Huarong Finance II Co Ltd 'EMTN'	4,88 %	22.11.2026	333.237	0,05
600.000	Hysan MTN Ltd 'EMTN'	2,82 %	04.09.2029	518.574	0,07
300.000	IFC Development Corporate Treasury Ltd	3,63 %	17.04.2029	274.287	0,04
1.050.000	Nan Fung Treasury III Ltd (Perpetual)	5,00 %	10.09.2023	809.655	0,11
200.000	Nan Fung Treasury Ltd 'EMTN'	5,00 %	05.09.2028	189.428	0,03
1.100.000	Nan Fung Treasury Ltd 'EMTN'	3,63 %	27.08.2030	935.264	0,13
300.000	Panther Ventures Ltd (Perpetual)	3,50 %	22.12.2023	193.830	0,03
1.100.000	Phoenix Lead Ltd (Perpetual)	4,85 %	23.02.2024	915.156	0,13
550.000	Pioneer Reward Ltd	1,30 %	09.04.2024	530.860	0,07

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Britische Jungferninseln (30. Juni 2022: 6,21 %) (Fortsetzung)					
700.000	SF Holding Investment 2021 Ltd	3,13 %	17.11.2031	595.560	0,08
200.000	Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd	2,38 %	13.07.2030	172.186	0,02
207.000	Sino-Ocean Land Treasure III Ltd FRN (Perpetual)	6,95 %	21.09.2027	24.912	0,00
650.000	Studio City Finance Ltd 'REGS'	6,50 %	15.01.2028	542.399	0,08
1.450.000	Studio City Finance Ltd 'REGS'	5,00 %	15.01.2029	1.076.176	0,15
1.950.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	0,75 %	28.09.2025	1.753.343	0,25
1.875.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	1,25 %	23.04.2026	1.672.594	0,24
1.625.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	1,00 %	28.09.2027	1.375.936	0,19
2.250.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	1,75 %	23.04.2028	1.934.572	0,27
1.500.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	1,38 %	28.09.2030	1.176.555	0,17
3.550.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	2,25 %	23.04.2031	2.925.413	0,41
1.002.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	4,63 %	22.07.2032	989.044	0,14
700.000	Vigorous Champion International Ltd 'EMTN'	4,38 %	10.09.2023	697.179	0,10
750.000	Vigorous Champion International Ltd 'EMTN'	2,75 %	02.06.2025	700.560	0,10
1.000.000	Wharf REIC Finance BVI Ltd 'EMTN'	3,50 %	17.01.2028	927.890	0,13
1.372.000	Wheelock MTN BVI Ltd 'EMTN'	2,38 %	25.01.2026	1.262.363	0,18
200.000	Xingsheng BVI Co Ltd	1,38 %	25.08.2024	189.696	0,03
400.000	Yili Holding Investment Ltd	1,63 %	19.11.2025	362.496	0,05
Britische Jungferninseln insgesamt				41.676.676	5,90
Kanada (30. Juni 2022: 0,52 %)					
2.100.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS'	5,00 %	18.05.2025	2.055.354	0,29
450.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS'	5,88 %	18.05.2030	453.663	0,06
600.000	St Marys Cement Inc Canada 'REGS'	5,75 %	28.01.2027	597.750	0,09
Kanada insgesamt				3.106.767	0,44
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 17,94 %)					
1.300.000	ABQ Finance Ltd 'EMTN'	3,13 %	24.09.2024	1.254.097	0,18
200.000	ABQ Finance Ltd 'EMTN'	2,00 %	06.07.2026	180.886	0,03
800.000	ABRA Global Finance 'REGS'	11,50 %	02.03.2028	648.800	0,09
1.020.000	ADIB Capital Invest 2 Ltd FRN (Perpetual)	7,13 %	20.09.2023	1.017.205	0,14

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 17,94 %) (Fortsetzung)					
200.000	Agile Group Holdings Ltd (Perpetual)	13,48 %	24.08.2023	32.190	0,00
200.000	Agile Group Holdings Ltd FRN (Perpetual)	7,88 %	31.07.2024	24.492	0,00
850.000	AKCB Finance Ltd	4,75 %	09.10.2023	845.844	0,12
600.000	AL Rajhi Sukuk Ltd	4,75 %	05.04.2028	602.838	0,09
750.000	Aldar Sukuk Ltd	4,75 %	29.09.2025	742.343	0,11
1.080.000	Aldar Sukuk No 2 Ltd	3,88 %	22.10.2029	1.016.561	0,14
350.000	Almarai Sukuk Ltd	4,31 %	05.03.2024	345.485	0,05
500.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd 'REGS'	5,63 %	07.10.2026	455.115	0,06
600.000	Arabian Centres Sukuk Ltd 'REGS'	5,38 %	26.11.2024	577.812	0,08
800.000	Arada Sukuk Ltd	8,13 %	08.06.2027	819.256	0,12
500.000	Baidu Inc	1,72 %	09.04.2026	451.970	0,06
400.000	Baidu Inc	3,63 %	06.07.2027	375.300	0,05
200.000	Baidu Inc	2,38 %	23.08.2031	162.354	0,02
1.700.000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands 'REGS'	3,20 %	27.01.2025	1.622.123	0,23
356.218	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd 'REGS' (Zero Coupon)	0,00 %	05.06.2034	249.972	0,04
850.000	BOS Funding Ltd 'EMTN'	4,00 %	18.09.2024	824.602	0,12
350.000	BSF Finance 'EMTN'	5,50 %	23.11.2027	354.736	0,05
1.150.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd 'EMTN'	3,50 %	16.05.2024	1.125.517	0,16
200.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd 'EMTN'	1,99 %	21.07.2025	185.452	0,03
250.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd 'EMTN'	1,80 %	22.07.2026	223.925	0,03
200.000	CDBL Funding 2 'EMTN'	1,38 %	04.03.2024	193.844	0,03
200.000	CDBL Funding 2 'EMTN'	2,00 %	04.03.2026	182.172	0,03
200.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	3,00 %	18.07.2024	194.144	0,03
300.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	1,88 %	17.06.2025	278.190	0,04
431.000	China Overseas Finance Cayman III Ltd	5,38 %	29.10.2023	429.970	0,06
850.000	China Overseas Finance Cayman VI Ltd	5,95 %	08.05.2024	847.705	0,12
317.000	China Overseas Finance Cayman VII Ltd	4,75 %	26.04.2028	308.425	0,04
200.000	China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd	2,45 %	09.02.2026	175.722	0,02
200.000	China Resources Land Ltd 'EMTN'	6,00 %	27.02.2024	199.288	0,03
550.000	China Resources Land Ltd 'EMTN' FRN (Perpetual)	3,75 %	09.12.2024	527.219	0,07
300.000	China SCE Group Holdings Ltd	7,38 %	09.04.2024	88.386	0,01

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 17,94 %) (Fortsetzung)					
900.000	China SCE Group Holdings Ltd	7,00 %	02.05.2025	125.604	0,02
2.035.000	CK Hutchison International 19 II Ltd 'REGS'	3,38 %	06.09.2049	1.561.211	0,22
470.000	CK Hutchison International 19 Ltd 'REGS'	3,25 %	11.04.2024	460.896	0,07
1.300.000	CK Hutchison International 19 Ltd 'REGS'	3,63 %	11.04.2029	1.207.076	0,17
1.003.000	CK Hutchison International 20 Ltd 'REGS'	2,50 %	08.05.2030	866.231	0,12
550.000	CK Hutchison International 20 Ltd 'REGS'	3,38 %	08.05.2050	418.786	0,06
800.000	CK Hutchison International 21 Ltd 'REGS'	1,50 %	15.04.2026	719.560	0,10
400.000	CK Hutchison International 21 Ltd 'REGS'	2,50 %	15.04.2031	338.628	0,05
807.000	CK Hutchison International 23 Ltd 'REGS'	4,75 %	21.04.2028	798.075	0,11
1.817.000	CK Hutchison International 23 Ltd 'REGS'	4,88 %	21.04.2033	1.799.266	0,25
900.000	Cosan Overseas Ltd (Perpetual)	8,25 %	05.11.2023	895.149	0,13
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd	7,25 %	08.04.2026	69.310	0,01
500.000	Country Garden Holdings Co Ltd	3,88 %	22.10.2030	142.430	0,02
500.000	Country Garden Holdings Co Ltd	3,30 %	12.01.2031	134.595	0,02
1.850.000	CSN Inova Ventures 'REGS'	6,75 %	28.01.2028	1.708.290	0,24
675.000	DIB Sukuk Ltd	2,74 %	16.02.2027	622.910	0,09
725.000	DIB Sukuk Ltd	5,49 %	30.11.2027	739.739	0,10
1.900.000	DIB Sukuk Ltd 'EMTN'	2,95 %	16.01.2026	1.792.194	0,25
1.300.000	DIB Sukuk Ltd 'EMTN'	1,96 %	22.06.2026	1.187.446	0,17
1.500.000	DIB Sukuk Ltd 'EMTN'	4,80 %	16.08.2028	1.488.210	0,21
1.400.000	DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd FRN (Perpetual)	6,25 %	22.01.2025	1.391.964	0,20
1.500.000	DIB Tier 1 Sukuk 4 Ltd FRN (Perpetual)	4,63 %	19.05.2026	1.408.215	0,20
200.000	EI Sukuk Co Ltd	1,83 %	23.09.2025	184.758	0,03
600.000	EI Sukuk Co Ltd 'EMTN'	2,08 %	02.11.2026	546.528	0,08
300.000	ENN Energy Holdings Ltd 'REGS'	4,63 %	17.05.2027	291.201	0,04
200.000	ENN Energy Holdings Ltd 'REGS'	2,63 %	17.09.2030	167.184	0,02
600.000	Esic Sukuk Ltd 'EMTN'	3,94 %	30.07.2024	580.446	0,08
1.881.000	Fab Sukuk Co Ltd	3,88 %	22.01.2024	1.860.403	0,26
1.700.000	Fab Sukuk Co Ltd	2,50 %	21.01.2025	1.624.571	0,23
1.100.000	Fab Sukuk Co Ltd	1,41 %	14.01.2026	1.003.739	0,14
400.000	Fab Sukuk Co Ltd 'EMTN'	4,58 %	17.01.2028	397.052	0,06

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 17,94 %) (Fortsetzung)					
1.000.000	Fibria Overseas Finance Ltd	5,50 %	17.01.2027	1.000.480	0,14
2.650.000	Formosa Group Cayman Ltd	3,38 %	22.04.2025	2.529.187	0,36
350.000	Foxconn Far East Ltd 'EMTN'	1,63 %	28.10.2025	317.370	0,05
1.600.000	Foxconn Far East Ltd 'EMTN'	2,50 %	28.10.2030	1.330.240	0,19
1.750.000	FWD Group Ltd FRN (Perpetual)	8,05 %	15.12.2023	1.589.612	0,23
1.200.000	FWD Group Ltd FRN (Perpetual)	6,38 %	13.09.2024	1.063.248	0,15
250.000	Geely Automobile Holdings Ltd FRN (Perpetual)	4,00 %	09.12.2024	238.062	0,03
850.000	GFH Sukuk Ltd	7,50 %	28.01.2025	837.786	0,12
1.050.000	Grupo Aval Ltd 'REGS'	4,38 %	04.02.2030	819.656	0,12
200.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd/The 'EMTN'	4,50 %	07.10.2025	195.306	0,03
600.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd/The 'EMTN'	2,88 %	27.05.2030	526.410	0,07
1.650.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd/The 'EMTN'	2,25 %	15.07.2031	1.347.605	0,19
400.000	HPHT Finance 19 Ltd	2,88 %	05.11.2024	384.592	0,05
1.350.000	HPHT Finance 21 II Ltd	1,50 %	17.09.2026	1.183.559	0,17
1.650.000	HPHT Finance 21 Ltd	2,00 %	19.03.2026	1.495.032	0,21
1.950.000	Hutchison Whampoa International 03/33 Ltd 'REGS'	7,45 %	24.11.2033	2.313.226	0,33
775.000	Hutchison Whampoa International 14 Ltd 'REGS'	3,63 %	31.10.2024	753.114	0,11
911.000	IHS Holding Ltd 'REGS'	5,63 %	29.11.2026	793.599	0,11
200.000	IHS Holding Ltd 'REGS'	6,25 %	29.11.2028	163.912	0,02
1.100.000	KWG Group Holdings Ltd (Defaulted)	5,88 %	10.11.2024	108.031	0,02
803.044	Lima Metro Line 2 Finance Ltd 'REGS'	5,88 %	05.07.2034	782.968	0,11
1.892.238	Lima Metro Line 2 Finance Ltd 'REGS'	4,35 %	05.04.2036	1.692.001	0,24
1.100.000	Link Finance Cayman 2009 Ltd/The 'EMTN'	2,88 %	21.07.2026	1.022.439	0,14
1.600.000	Link Finance Cayman 2009 Ltd/The 'EMTN'	2,75 %	19.01.2032	1.361.152	0,19
500.000	Longfor Group Holdings Ltd	3,95 %	16.09.2029	366.155	0,05
1.800.000	MAF Global Securities Ltd FRN (Perpetual)	7,88 %	30.06.2027	1.819.836	0,26
1.950.000	MAF Sukuk Ltd	4,64 %	14.05.2029	1.900.333	0,27
1.050.000	MAF Sukuk Ltd 'EMTN'	3,93 %	28.02.2030	979.871	0,14
950.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	4,88 %	06.06.2025	896.753	0,13
439.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	5,25 %	26.04.2026	407.410	0,06
250.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	5,63 %	17.07.2027	224.650	0,03

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 17,94 %) (Fortsetzung)					
1.550.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	5,75 %	21.07.2028	1.355.281	0,19
2.050.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	5,38 %	04.12.2029	1.688.687	0,24
1.350.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS'	5,38 %	15.05.2024	1.331.842	0,19
650.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS'	5,88 %	15.05.2026	618.904	0,09
450.000	MTR Corp CI Ltd	2,50 %	02.11.2026	413.150	0,06
700.000	Odebrecht Holdco Finance Ltd 'REGS' (Zero Coupon)	0,00 %	10.09.2058	2.800	0,00
265.500	Poinsettia Finance Ltd 'REGS'	6,63 %	17.06.2031	218.464	0,03
2.574.000	QNB Finance Ltd 'EMTN'	2,63 %	12.05.2025	2.436.342	0,35
1.550.000	QNB Finance Ltd 'EMTN'	1,38 %	26.01.2026	1.402.177	0,20
450.000	QNB Finance Ltd 'EMTN'	2,75 %	12.02.2027	415.089	0,06
2.100.000	Riyad Sukuk Ltd FRN	3,17 %	25.02.2030	1.992.018	0,28
900.000	Riyad Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual)	4,00 %	16.02.2027	828.144	0,12
1.550.000	SNB Funding Ltd	2,75 %	02.10.2024	1.491.798	0,21
2.800.000	Sands China Ltd	5,63 %	08.08.2025	2.720.172	0,39
450.000	Sands China Ltd	4,30 %	08.01.2026	420.885	0,06
350.000	Sands China Ltd	2,80 %	08.03.2027	302.446	0,04
2.800.000	Sands China Ltd	5,90 %	08.08.2028	2.661.750	0,38
500.000	Sands China Ltd	3,35 %	08.03.2029	413.970	0,06
1.000.000	Sands China Ltd	4,88 %	18.06.2030	882.660	0,13
750.000	Sands China Ltd	3,75 %	08.08.2031	607.500	0,09
1.213.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 2 'REGS'	5,06 %	08.04.2043	1.165.086	0,17
3.250.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 3 'REGS'	4,00 %	08.04.2024	3.195.627	0,45
1.750.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 3 'REGS'	5,50 %	08.04.2044	1.724.993	0,24
376.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4	4,22 %	27.01.2024	371.138	0,05
2.450.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4	4,72 %	27.09.2028	2.467.322	0,35
1.400.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 5	1,74 %	17.09.2025	1.299.438	0,18
1.202.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 5	2,41 %	17.09.2030	1.039.958	0,15
1.099.000	Saudi Electricity Sukuk Programme Co	4,63 %	11.04.2033	1.087.735	0,15
1.560.000	Saudi Electricity Sukuk Programme Co	5,68 %	11.04.2053	1.540.843	0,22
330.000	Shimao Group Holdings Ltd	5,20 %	30.01.2025	28.050	0,00
300.000	Shimao Group Holdings Ltd	5,20 %	16.01.2027	25.500	0,00

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 17,94 %) (Fortsetzung)					
855.000	Shui On Development Holding Ltd	5,75 %	12.11.2023	825.426	0,12
400.000	SIB Sukuk Co III Ltd	2,85 %	23.06.2025	381.192	0,05
600.000	SNB Sukuk Ltd	2,34 %	19.01.2027	549.348	0,08
400.000	Soar Wise Ltd 'EMTN'	1,75 %	30.03.2024	387.592	0,06
1.050.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd 'EMTN'	2,88 %	21.01.2030	928.840	0,13
1.250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd 'EMTN'	2,75 %	13.05.2030	1.090.225	0,15
300.000	Times China Holdings Ltd (Defaulted)	5,55 %	04.06.2024	21.000	0,00
200.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	1,63 %	24.09.2025	181.624	0,03
850.000	Wynn Macau Ltd 'REGS'	5,50 %	15.01.2026	787.844	0,11
550.000	Wynn Macau Ltd 'REGS'	5,50 %	01.10.2027	487.094	0,07
920.000	Wynn Macau Ltd 'REGS'	5,63 %	26.08.2028	793.500	0,11
350.000	Wynn Macau Ltd 'REGS'	5,13 %	15.12.2029	291.375	0,04
773.000	XP Inc 'REGS'	3,25 %	01.07.2026	682.304	0,10
Cayman-Inseln insgesamt				118.096.335	16,73
Chile (30. Juni 2022: 2,81 %)					
600.000	Agrosuper SA 'REGS'	4,60 %	20.01.2032	506.298	0,07
650.000	Banco de Credito e Inversiones SA 'REGS'	3,50 %	12.10.2027	599.111	0,08
450.000	Banco de Credito e Inversiones SA 'REGS'	2,88 %	14.10.2031	371.920	0,05
2.100.000	Banco Santander Chile 'REGS'	2,70 %	10.01.2025	2.002.035	0,28
700.000	Banco Santander Chile 'REGS'	3,18 %	26.10.2031	605.871	0,09
1.300.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA	4,50 %	01.08.2024	1.277.562	0,18
200.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS'	4,20 %	29.01.2030	178.110	0,02
250.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS'	5,15 %	29.01.2050	200.735	0,03
1.559.000	Cencosud SA 'REGS'	5,15 %	12.02.2025	1.538.827	0,22
1.250.000	Cencosud SA 'REGS'	4,38 %	17.07.2027	1.187.325	0,17
1.150.000	Cia Cerveceras Unidas SA 'REGS'	3,35 %	19.01.2032	977.121	0,14
950.000	Colbun SA 'REGS'	3,15 %	19.01.2032	797.820	0,11
850.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS'	4,75 %	01.08.2026	826.778	0,12
1.078.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS'	3,05 %	14.09.2032	844.343	0,12
1.085.251	GNL Quintero SA 'REGS'	4,63 %	31.07.2029	1.055.407	0,15

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Chile (30. Juni 2022: 2,81 %) (Fortsetzung)					
2.100.000	Interchile SA 'REGS'	4,50 %	30.06.2056	1.734.862	0,25
1.250.000	Inversiones CMPC SA 'REGS'	4,75 %	15.09.2024	1.231.562	0,17
548.000	Inversiones CMPC SA 'REGS'	4,38 %	04.04.2027	524.951	0,07
650.000	Inversiones CMPC SA 'REGS'	3,00 %	06.04.2031	532.058	0,08
395.000	Inversiones CMPC SA 'REGS'	6,13 %	23.06.2033	397.323	0,06
700.000	Latam Airlines Group SA 'REGS'	13,38 %	15.10.2029	750.750	0,11
450.000	Telefonica Moviles Chile SA 'REGS'	3,54 %	18.11.2031	356.625	0,05
Chile insgesamt				18.497.394	2,62
China (30. Juni 2022: 0,36 %)					
700.000	Bank of China Ltd/Frankfurt 'EMTN'	3,13 %	16.06.2025	669.095	0,09
200.000	Bank of China Ltd/Luxembourg 'EMTN' FRN	6,04 %	25.11.2025	201.113	0,03
1.000.000	Bank of China Ltd/New York NY 'EMTN'	4,63 %	26.06.2026	988.420	0,14
200.000	Bank of China Ltd/Paris 'EMTN'	0,95 %	21.09.2023	198.028	0,03
500.000	Bank of Communications Co Ltd FRN (Perpetual)	3,80 %	18.11.2025	479.680	0,07
200.000	China Construction Bank Corp/Hong Kong 'EMTN'	1,25 %	04.08.2025	183.296	0,03
200.000	China Development Bank Financial Leasing Co Ltd FRN	2,88 %	28.09.2030	186.432	0,03
400.000	China Everbright Bank Co Ltd/Hong Kong 'EMTN'	0,84 %	15.06.2024	382.320	0,05
750.000	China Everbright Bank Co Ltd/Hong Kong 'EMTN' FRN	6,15 %	03.08.2023	750.315	0,11
200.000	China Merchants Bank Co Ltd/Hong Kong 'EMTN'	1,20 %	10.09.2025	182.096	0,02
200.000	China Minsheng Banking Corp Ltd/Hong Kong FRN	6,51 %	22.10.2023	199.974	0,03
1.700.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Hong Kong 'GMTN'	1,63 %	28.10.2026	1.511.538	0,21
China insgesamt				5.932.307	0,84
Kolumbien (30. Juni 2022: 2,73 %)					
200.000	Banco Davivienda SA 'REGS' FRN (Perpetual)	6,65 %	22.04.2031	146.904	0,02
1.727.000	Banco de Bogota SA 'REGS'	6,25 %	12.05.2026	1.667.401	0,24
1.550.000	Bancolombia SA	3,00 %	29.01.2025	1.470.159	0,21
500.000	Bancolombia SA FRN	6,91 %	18.10.2027	472.420	0,07
300.000	Bancolombia SA FRN	4,63 %	18.12.2029	255.435	0,04
250.000	Colombia Telecomunicaciones SA ESP 'REGS'	4,95 %	17.07.2030	184.530	0,02

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Kolumbien (30. Juni 2022: 2,73 %) (Fortsetzung)					
1.650.000	Ecopetrol SA	4,13 %	16.01.2025	1.579.792	0,22
1.980.000	Ecopetrol SA	5,38 %	26.06.2026	1.889.059	0,27
1.460.000	Ecopetrol SA	8,63 %	19.01.2029	1.460.730	0,21
2.750.000	Ecopetrol SA	6,88 %	29.04.2030	2.496.038	0,35
1.730.000	Ecopetrol SA	4,63 %	02.11.2031	1.322.931	0,19
3.630.000	Ecopetrol SA	8,88 %	13.01.2033	3.578.363	0,51
39.000	Ecopetrol SA	7,38 %	18.09.2043	32.304	0,00
1.228.000	Ecopetrol SA	5,88 %	28.05.2045	833.382	0,12
600.000	Ecopetrol SA	5,88 %	02.11.2051	392.700	0,05
1.250.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA 'REGS'	5,50 %	29.04.2026	1.189.763	0,17
1.108.000	SURA Asset Management SA 'REGS'	4,88 %	17.04.2024	1.091.380	0,15
Kolumbien insgesamt				20.063.291	2,84
Guatemala (30. Juni 2022: – %)					
200.000	CT Trust 'REGS'	5,13 %	03.02.2032	160.500	0,02
Guatemala insgesamt				160.500	0,02
Hongkong (30. Juni 2022: 4,76 %)					
484.000	AIA Group Ltd '144A'	4,95 %	04.04.2033	482.877	0,07
1.700.000	AIA Group Ltd 'GMTN' FRN (Perpetual)	2,70 %	07.04.2026	1.504.874	0,21
1.700.000	AIA Group Ltd 'REGS'	5,63 %	25.10.2027	1.738.199	0,25
1.350.000	AIA Group Ltd 'REGS'	3,90 %	06.04.2028	1.288.305	0,18
900.000	AIA Group Ltd 'REGS'	3,60 %	09.04.2029	833.256	0,12
500.000	AIA Group Ltd 'REGS'	3,38 %	07.04.2030	456.655	0,06
2.450.000	AIA Group Ltd 'REGS'	3,20 %	16.09.2040	1.875.475	0,27
750.000	AIA Group Ltd 'REGS'	4,88 %	11.03.2044	726.412	0,10
1.450.000	Bank of China Hong Kong Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)	5,90 %	14.09.2023	1.449.086	0,21
750.000	Bank of Communications Hong Kong Ltd FRN	2,30 %	08.07.2031	676.155	0,10
600.000	Bank of Communications Hong Kong Ltd FRN (Perpetual)	3,73 %	03.03.2025	577.536	0,08
400.000	Bank of East Asia Ltd/The 'EMTN' FRN	4,00 %	29.05.2030	368.848	0,05
1.000.000	Bank of East Asia Ltd/The 'EMTN' FRN	4,88 %	22.04.2032	903.350	0,13

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Hongkong (30. Juni 2022: 4,76 %) (Fortsetzung)					
672.000	Bank of East Asia Ltd/The 'EMTN' FRN (Perpetual)	5,83 %	21.10.2025	585.749	0,08
400.000	Bank of East Asia Ltd/The FRN (Perpetual)	5,88 %	19.09.2024	364.524	0,05
1.050.000	Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd 'EMTN'	4,88 %	17.08.2026	1.012.620	0,14
750.000	China CITIC Bank International Ltd 'EMTN' FRN	4,63 %	28.02.2029	742.365	0,10
900.000	China CITIC Bank International Ltd 'EMTN' FRN (Perpetual)	7,10 %	06.11.2023	902.070	0,13
550.000	China CITIC Bank International Ltd 'EMTN' FRN (Perpetual)	3,25 %	29.07.2026	508.349	0,07
200.000	China Ping An Insurance Overseas Holdings Ltd 'EMTN'	2,85 %	12.08.2031	155.004	0,02
200.000	China Zheshang Bank Co Ltd/Hong Kong 'EMTN'	1,10 %	16.03.2024	193.512	0,03
200.000	Far East Horizon Ltd 'EMTN'	2,63 %	03.03.2024	193.144	0,03
200.000	GLP China Holdings Ltd 'EMTN'	4,97 %	26.02.2024	178.542	0,03
380.000	GLP China Holdings Ltd 'EMTN'	2,95 %	29.03.2026	236.440	0,03
700.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	3,75 %	05.03.2024	689.430	0,10
450.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	1,63 %	02.11.2024	425.718	0,06
200.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	1,75 %	25.08.2025	183.548	0,03
200.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	1,75 %	02.08.2026	178.594	0,03
650.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	2,25 %	02.11.2026	585.319	0,08
500.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN' FRN	6,43 %	20.11.2024	499.875	0,07
600.000	Lenovo Group Ltd 'EMTN'	5,88 %	24.04.2025	595.938	0,08
373.000	Lenovo Group Ltd 'REGS'	5,83 %	27.01.2028	370.176	0,05
400.000	Lenovo Group Ltd 'REGS'	3,42 %	02.11.2030	334.804	0,05
2.730.000	MTR Corp Ltd 'EMTN'	1,63 %	19.08.2030	2.248.428	0,32
850.000	Nanyang Commercial Bank Ltd FRN	3,80 %	20.11.2029	810.841	0,11
300.000	Swire Properties MTN Financing Ltd 'EMTN'	3,50 %	10.01.2028	280.779	0,04
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 'EMTN'	5,35 %	11.03.2024	198.210	0,03
300.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 'EMTN'	4,20 %	07.06.2024	291.660	0,04
400.000	Westwood Group Holdings Ltd 'EMTN'	2,80 %	20.01.2026	366.840	0,05
Hongkong insgesamt				26.013.507	3,68
Ungarn (30. Juni 2022: – %)					
1.070.000	OTP Bank Nyrt 'EMTN' FRN	8,75 %	15.05.2033	1.068.010	0,15
Ungarn insgesamt				1.068.010	0,15

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Indien (30. Juni 2022: 4,03 %)					
900.000	Adani Green Energy Ltd 'REGS'	4,38 %	08.09.2024	832.653	0,12
950.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS'	4,20 %	04.08.2027	809.400	0,11
351.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS'	4,38 %	03.07.2029	281.688	0,04
300.000	Axis Bank Ltd/Gandhinagar 'REGS' FRN (Perpetual)	4,10 %	08.09.2026	261.927	0,04
250.000	Bharat Petroleum Corp Ltd 'EMTN'	4,00 %	08.05.2025	241.137	0,03
1.800.000	Bharti Airtel Ltd 'REGS'	4,38 %	10.06.2025	1.749.096	0,25
2.550.000	Bharti Airtel Ltd 'REGS'	3,25 %	03.06.2031	2.200.701	0,31
200.000	Delhi International Airport Ltd 'REGS'	6,13 %	31.10.2026	193.996	0,03
1.200.000	Future Retail Ltd 'REGS' (Defaulted)	5,60 %	22.01.2025	2.844	0,00
600.000	HDFC Bank Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)	3,70 %	25.08.2026	520.260	0,07
1.600.000	HDFC Bank Ltd/Gandhinagar 'EMTN'	5,69 %	02.03.2026	1.596.240	0,23
500.000	Hindustan Petroleum Corp Ltd	4,00 %	12.07.2027	469.805	0,07
950.000	Indian Oil Corp Ltd	4,75 %	16.01.2024	943.170	0,13
400.000	Indian Railway Finance Corp Ltd	3,84 %	13.12.2027	373.388	0,05
400.000	Indian Railway Finance Corp Ltd 'REGS'	3,57 %	21.01.2032	349.140	0,05
168.000	JSW Hydro Energy Ltd 'REGS'	4,13 %	18.05.2031	141.416	0,02
250.000	JSW Steel Ltd	5,95 %	18.04.2024	247.935	0,04
300.000	JSW Steel Ltd 'REGS'	5,05 %	05.04.2032	241.527	0,03
750.000	ONGC Videsh Ltd	4,63 %	15.07.2024	737.719	0,10
1.108.000	Power Finance Corp Ltd	4,50 %	18.06.2029	1.028.989	0,15
1.750.000	Power Finance Corp Ltd 'GMTN'	3,35 %	16.05.2031	1.476.492	0,21
200.000	Power Finance Corp Ltd 'REGS'	6,15 %	06.12.2028	202.222	0,03
1.000.000	Power Finance Corp Ltd 'REGS'	3,95 %	23.04.2030	896.660	0,13
600.000	REC Ltd	3,50 %	12.12.2024	577.152	0,08
750.000	REC Ltd 'GMTN'	3,38 %	25.07.2024	727.343	0,10
700.000	REC Ltd 'GMTN'	2,25 %	01.09.2026	626.843	0,09
230.000	REC Ltd 'REGS'	5,25 %	13.11.2023	229.131	0,03
2.050.000	REC Ltd 'REGS'	5,63 %	11.04.2028	2.026.671	0,29
1.300.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	4,13 %	28.01.2025	1.268.072	0,18
1.100.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	3,67 %	30.11.2027	1.031.514	0,15
3.630.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	2,88 %	12.01.2032	3.025.315	0,43

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Indien (30. Juni 2022: 4,03 %) (Fortsetzung)					
250.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	6,25 %	19.10.2040	268.147	0,04
800.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	4,88 %	10.02.2045	723.536	0,10
2.777.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	3,63 %	12.01.2052	1.982.361	0,28
1.309.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	3,75 %	12.01.2062	918.839	0,13
1.000.000	ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries 'REGS'	4,50 %	14.07.2028	844.830	0,12
600.000	Shriram Finance Ltd 'REGS'	4,40 %	13.03.2024	587.232	0,08
Indien insgesamt				30.635.391	4,34
Indonesien (30. Juni 2022: 1,61 %)					
600.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 'EMTN'	3,75 %	11.04.2024	588.984	0,08
250.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 'EMTN'	4,75 %	13.05.2025	245.420	0,04
500.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 'EMTN'	3,75 %	30.03.2026	460.820	0,07
750.000	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	3,95 %	28.03.2024	738.442	0,10
1.700.000	Freeport Indonesia PT 'REGS'	4,76 %	14.04.2027	1.636.726	0,23
500.000	Freeport Indonesia PT 'REGS'	5,32 %	14.04.2032	471.240	0,07
550.000	Freeport Indonesia PT 'REGS'	6,20 %	14.04.2052	495.748	0,07
1.457.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	3,40 %	09.06.2031	1.225.628	0,17
500.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	3,54 %	27.04.2032	417.938	0,06
350.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	4,75 %	09.06.2051	260.705	0,04
Indonesien insgesamt				6.541.651	0,93
International (30. Juni 2022: 0,77 %)					
2.030.000	Canpack SA / Canpack US LLC 'REGS'	3,88 %	15.11.2029	1.636.302	0,23
250.000	Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd 'REGS'	8,75 %	25.05.2024	228.657	0,03
950.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank/The 'EMTN'	4,88 %	23.05.2024	910.813	0,13
250.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank/The 'EMTN'	4,13 %	30.06.2028	195.566	0,03
1.750.000	GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC 'REGS'	7,13 %	31.07.2026	1.694.385	0,24
International insgesamt				4.665.723	0,66

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Irland (30. Juni 2022: 0,39 %)					
1.600.000	C&W Senior Financing DAC 'REGS'	6,88 %	15.09.2027	1.388.000	0,20
Irland insgesamt				1.388.000	0,20
Isle of Man (30. Juni 2022: 0,15 %)					
300.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc	3,38 %	01.11.2028	262.530	0,03
316.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc	3,75 %	01.10.2030	269.349	0,04
Isle of Man insgesamt				531.879	0,07
Israel (30. Juni 2022: 1,14 %)					
1.105.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN	3,26 %	21.01.2032	943.781	0,14
278.000	Bank Leumi Le-Israel BM '144A'	5,13 %	27.07.2027	275.859	0,04
1.600.000	Bank Leumi Le-Israel BM '144A' FRN	3,28 %	29.01.2031	1.427.552	0,20
1.300.000	Energear Israel Finance Ltd '144A'	4,50 %	30.03.2024	1.284.699	0,18
1.279.382	Energear Israel Finance Ltd '144A'	4,88 %	30.03.2026	1.185.347	0,17
410.000	Energear Israel Finance Ltd '144A'	5,38 %	30.03.2028	369.082	0,05
1.225.000	Mizrahi Tefahot Bank Ltd '144A' FRN	3,08 %	07.04.2031	1.067.980	0,15
Israel insgesamt				6.554.300	0,93
Jersey (30. Juni 2022: 1,27 %)					
984.650	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	1,75 %	30.09.2027	906.961	0,13
2.173.395	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	2,16 %	31.03.2034	1.841.952	0,26
2.255.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	2,63 %	31.03.2036	1.818.905	0,26
2.280.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	3,25 %	30.09.2040	1.763.968	0,25
3.039.520	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	2,94 %	30.09.2040	2.435.476	0,34
850.000	Oriflame Investment Holding Plc 'REGS'	5,13 %	04.05.2026	391.000	0,06
1.050.000	Petrofac Ltd 'REGS'	9,75 %	15.11.2026	808.500	0,11
Jersey insgesamt				9.966.762	1,41
Kasachstan (30. Juni 2022: – %)					
200.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	4,75 %	19.04.2027	189.320	0,03
980.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	5,38 %	24.04.2030	909.146	0,13

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Kasachstan (30. Juni 2022: – %) (Fortsetzung)					
330.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	3,50 %	14.04.2033	255.014	0,04
1.260.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	5,75 %	19.04.2047	1.024.002	0,14
2.110.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	6,38 %	24.10.2048	1.799.914	0,25
Kasachstan insgesamt				4.177.396	0,59
Korea, Republik (Südkorea) (30. Juni 2022: 3,75 %)					
200.000	Hana Bank 'REGS'	1,25 %	16.12.2026	173.086	0,03
1.120.000	Hana Bank 'REGS'	3,25 %	30.03.2027	1.049.373	0,15
500.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd 'REGS' FRN	3,38 %	04.02.2032	445.330	0,06
825.000	Hyundai Capital Services Inc 'REGS'	1,25 %	08.02.2026	728.252	0,10
600.000	Kookmin Bank 'REGS'	1,75 %	04.05.2025	558.780	0,08
850.000	Kookmin Bank 'REGS'	1,38 %	06.05.2026	757.435	0,11
739.000	Kookmin Bank 'REGS'	4,63 %	21.04.2028	726.193	0,10
450.000	Kookmin Bank 'REGS'	2,50 %	04.11.2030	367.960	0,05
250.000	Kookmin Bank 'REGS' FRN (Perpetual)	4,35 %	02.07.2024	242.692	0,03
1.100.000	Korea East-West Power Co Ltd 'REGS'	3,60 %	06.05.2025	1.057.914	0,15
367.000	LG Chem Ltd 'REGS'	3,25 %	15.10.2024	354.882	0,05
1.400.000	LG Chem Ltd 'REGS'	1,38 %	07.07.2026	1.230.348	0,17
900.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS'	1,38 %	21.10.2026	786.312	0,11
1.450.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS'	4,50 %	12.04.2028	1.418.231	0,20
1.200.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' FRN	7,31 %	24.04.2025	1.217.376	0,17
550.000	Shinhan Financial Group Co Ltd FRN (Perpetual)	5,88 %	13.08.2023	547.250	0,08
1.250.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS'	1,35 %	10.01.2026	1.126.513	0,16
2.050.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN	3,34 %	05.02.2030	1.951.374	0,28
250.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)	2,88 %	12.05.2026	219.417	0,03
1.900.000	SK Hynix Inc	3,00 %	17.09.2024	1.822.879	0,26
850.000	SK Hynix Inc 'REGS'	1,00 %	19.01.2024	825.154	0,12
1.300.000	SK Hynix Inc 'REGS'	6,25 %	17.01.2026	1.297.907	0,18
1.050.000	SK Hynix Inc 'REGS'	1,50 %	19.01.2026	928.578	0,13
450.000	SK Hynix Inc 'REGS'	6,38 %	17.01.2028	451.814	0,06
350.000	SK Hynix Inc 'REGS'	2,38 %	19.01.2031	269.490	0,04

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Korea, Republik (Südkorea) (30. Juni 2022: 3,75 %) (Fortsetzung)					
1.750.000	SK Hynix Inc 'REGS'	6,50 %	17.01.2033	1.768.060	0,25
850.000	Woori Bank 'REGS'	4,75 %	30.04.2024	838.406	0,12
200.000	Woori Bank 'REGS'	0,75 %	01.02.2026	177.070	0,03
388.000	Woori Bank 'REGS'	2,00 %	20.01.2027	350.162	0,05
425.000	Woori Bank 'REGS'	4,88 %	26.01.2028	421.167	0,06
200.000	Woori Bank 'REGS' FRN (Perpetual)	4,25 %	04.10.2024	192.108	0,03
Korea, Republik (Südkorea) insgesamt				24.301.513	3,44
Luxemburg (30. Juni 2022: 3,23 %)					
300.000	Adecoagro SA 'REGS'	6,00 %	21.09.2027	278.076	0,04
2.300.000	Altice Financing SA 'REGS'	5,00 %	15.01.2028	1.833.767	0,26
3.910.000	Altice Financing SA 'REGS'	5,75 %	15.08.2029	3.031.149	0,43
2.250.000	Amaggi Luxembourg International Sarl 'REGS'	5,25 %	28.01.2028	2.039.310	0,29
865.000	Atento Luxco 1 SA 'REGS'	8,00 %	10.02.2026	136.194	0,02
900.000	Cosan Luxembourg SA 'REGS'	7,00 %	20.01.2027	898.839	0,13
1.650.000	CSN Resources SA 'REGS'	4,63 %	10.06.2031	1.255.856	0,18
2.500.000	CSN Resources SA 'REGS'	5,88 %	08.04.2032	2.008.750	0,28
1.250.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS'	3,55 %	31.08.2036	1.063.262	0,15
1.850.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS'	4,39 %	30.11.2046	1.445.313	0,20
1.432.123	Tierra Mojada Luxembourg II Sarl 'REGS'	5,75 %	01.12.2040	1.219.395	0,17
3.500.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 'REGS'	6,13 %	23.02.2038	3.569.265	0,51
2.300.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 'REGS'	6,51 %	23.02.2042	2.378.729	0,34
574.769	Guara Norte Sarl 'REGS'	5,20 %	15.06.2034	499.618	0,07
1.710.265	MC Brazil Downstream Trading SARL 'REGS'	7,25 %	30.06.2031	1.140.593	0,16
855.000	Millicom International Cellular SA 'REGS'	6,25 %	25.03.2029	763.353	0,11
3.550.000	Millicom International Cellular SA 'REGS'	4,50 %	27.04.2031	2.717.525	0,38
1.100.000	Minerva Luxembourg SA 'REGS'	4,38 %	18.03.2031	856.295	0,12
1.300.000	Nexa Resources SA 'REGS'	6,50 %	18.01.2028	1.242.878	0,18
700.000	Petrorio Luxembourg Trading Sarl 'REGS'	6,13 %	09.06.2026	665.371	0,09
500.000	Raizen Fuels Finance SA 'REGS'	5,30 %	20.01.2027	487.290	0,07
600.000	Rede D'or Finance Sarl 'REGS'	4,95 %	17.01.2028	547.074	0,08

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Luxemburg (30. Juni 2022: 3,23 %) (Fortsetzung)					
1.000.000	Rede D'or Finance Sarl 'REGS'	4,50 %	22.01.2030	853.900	0,12
635.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS'	4,20 %	18.01.2032	505.651	0,07
1.050.000	Simpar Europe SA 'REGS'	5,20 %	26.01.2031	833.028	0,12
1.710.000	TMS Issuer Sarl 'REGS'	5,78 %	23.08.2032	1.755.913	0,25
Luxemburg insgesamt				34.026.394	4,82
Malaysia (30. Juni 2022: 0,80 %)					
1.150.000	Axiata SPV2 Bhd 'EMTN'	4,36 %	24.03.2026	1.110.187	0,16
854.000	Axiata SPV2 Bhd 'EMTN'	2,16 %	19.08.2030	719.042	0,10
1.050.000	Axiata Spv5 Labuan Ltd 'EMTN'	3,06 %	19.08.2050	741.867	0,11
1.141.000	CIMB Bank Bhd 'EMTN' FRN	6,32 %	09.10.2024	1.140.715	0,16
400.000	CIMB Bank Bhd 'REGS'	2,13 %	20.07.2027	358.152	0,05
450.000	GENM Capital Labuan Ltd 'REGS'	3,88 %	19.04.2031	363.078	0,05
1.200.000	Malayan Banking Bhd 'EMTN' FRN	6,12 %	16.08.2024	1.200.348	0,17
750.000	MISC Capital Two Labuan Ltd 'REGS'	3,75 %	06.04.2027	701.783	0,10
Malaysia insgesamt				6.335.172	0,90
Marshallinseln (30. Juni 2022: 0,41 %)					
156.064	Nakilat Inc 'REGS'	6,07 %	31.12.2033	162.898	0,02
500.000	Seaspan Corp 'REGS'	5,50 %	01.08.2029	392.215	0,06
Marshallinseln insgesamt				555.113	0,08
Mauritius (30. Juni 2022: 1,33 %)					
646.468	Greenko Power II Ltd 'REGS'	4,30 %	13.12.2028	561.418	0,08
1.450.000	Greenko Solar Mauritius Ltd 'REGS'	5,55 %	29.01.2025	1.397.119	0,20
400.000	Greenko Solar Mauritius Ltd 'REGS'	5,95 %	29.07.2026	372.968	0,05
1.800.000	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd 'REGS'	5,50 %	06.04.2025	1.719.864	0,24
863.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS'	7,00 %	18.12.2025	815.371	0,12
609.000	Network i2i Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)	5,65 %	15.01.2025	589.914	0,08
Mauritius insgesamt				5.456.654	0,77

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Mexiko (30. Juni 2022: 8,40 %)					
350.000	Alpek SAB de CV 'REGS'	4,25 %	18.09.2029	312.410	0,04
200.000	Alpek SAB de CV 'REGS'	3,25 %	25.02.2031	161.620	0,02
1.000.000	Alsea SAB de CV 'REGS'	7,75 %	14.12.2026	992.500	0,14
1.050.000	America Movil SAB de CV	3,63 %	22.04.2029	958.913	0,14
1.000.000	America Movil SAB de CV	2,88 %	07.05.2030	867.190	0,12
1.175.000	America Movil SAB de CV	4,70 %	21.07.2032	1.127.759	0,16
1.300.000	America Movil SAB de CV	6,38 %	01.03.2035	1.408.134	0,20
3.600.000	America Movil SAB de CV	6,13 %	30.03.2040	3.813.192	0,54
1.850.000	America Movil SAB de CV	4,38 %	16.07.2042	1.614.883	0,23
1.950.000	America Movil SAB de CV	4,38 %	22.04.2049	1.686.750	0,24
800.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)	6,75 %	27.09.2024	767.072	0,11
600.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)	5,88 %	24.01.2027	507.375	0,07
310.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)	7,63 %	10.01.2028	279.639	0,04
600.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)	7,50 %	27.06.2029	520.008	0,07
450.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)	8,38 %	14.10.2030	413.960	0,06
725.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)	6,63 %	24.01.2032	556.438	0,08
2.985.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS'	5,38 %	17.04.2025	2.943.956	0,42
1.338.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' FRN	5,95 %	01.10.2028	1.326.292	0,19
900.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS'	1,88 %	18.09.2025	827.874	0,12
2.347.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS' FRN	5,13 %	18.01.2033	2.043.791	0,29
1.350.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS' FRN	5,88 %	13.09.2034	1.201.770	0,17
850.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS'	7,45 %	15.11.2029	566.589	0,08
550.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS'	6,99 %	20.02.2032	352.000	0,05
1.300.000	Cemex SAB de CV 'REGS'	5,45 %	19.11.2029	1.248.845	0,18
450.000	Cemex SAB de CV 'REGS'	5,20 %	17.09.2030	419.139	0,06
1.400.000	Cemex SAB de CV 'REGS'	3,88 %	11.07.2031	1.172.360	0,17
461.000	Cemex SAB de CV 'REGS' FRN (Perpetual)	5,13 %	08.06.2026	409.949	0,06
1.100.000	Cemex SAB de CV 'REGS' FRN (Perpetual)	9,13 %	14.03.2028	1.111.913	0,16
400.000	Cibanco SA Ibm / PLA Administradora Industrial S de RL de CV 'REGS'	4,96 %	18.07.2029	376.304	0,05
1.250.000	Coca-Cola Femsa SAB de CV	1,85 %	01.09.2032	975.813	0,14

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Mexiko (30. Juni 2022: 8,40 %) (Fortsetzung)					
404.753	Cometa Energia SA de CV 'REGS'	6,38 %	24.04.2035	394.116	0,06
500.000	Grupo Aeromexico SAB de CV 'REGS'	8,50 %	17.03.2027	446.795	0,06
975.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS'	3,88 %	27.06.2024	955.032	0,13
650.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS'	4,88 %	27.06.2044	595.725	0,08
910.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS'	4,70 %	10.11.2047	819.410	0,12
800.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS'	4,00 %	06.09.2049	645.600	0,09
1.300.000	Grupo Televisa SAB	6,63 %	15.01.2040	1.343.459	0,19
350.000	Grupo Televisa SAB	5,00 %	13.05.2045	300.804	0,04
346.000	Grupo Televisa SAB	6,13 %	31.01.2046	342.277	0,05
200.000	Grupo Televisa SAB	5,25 %	24.05.2049	179.810	0,02
300.000	Industrias Penoles SAB de CV 'REGS'	4,15 %	12.09.2029	276.264	0,04
850.000	Industrias Penoles SAB de CV 'REGS'	5,65 %	12.09.2049	764.090	0,11
525.000	Industrias Penoles SAB de CV 'REGS'	4,75 %	06.08.2050	417.727	0,06
850.000	Infraestructura Energetica Nova SAPI de CV 'REGS'	4,88 %	14.01.2048	641.495	0,09
1.300.000	Infraestructura Energetica Nova SAPI de CV 'REGS'	4,75 %	15.01.2051	958.750	0,14
300.000	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 'REGS'	2,43 %	01.07.2031	254.625	0,04
1.600.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	1,88 %	11.05.2026	1.431.376	0,20
1.050.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	4,00 %	04.10.2027	984.900	0,14
400.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	2,88 %	11.05.2031	316.028	0,04
394.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	5,88 %	17.09.2044	342.224	0,05
2.062.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	5,50 %	15.01.2048	1.662.096	0,23
2.100.000	Sigma Alimentos SA de CV 'REGS'	4,13 %	02.05.2026	2.000.586	0,28
1.700.000	Sitios Latinoamerica SAB de CV 'REGS'	5,38 %	04.04.2032	1.530.017	0,22
1.700.000	Trust Fibra Uno 'REGS'	5,25 %	15.12.2024	1.664.742	0,24
550.000	Trust Fibra Uno 'REGS'	5,25 %	30.01.2026	532.229	0,07
900.000	Trust Fibra Uno 'REGS'	6,95 %	30.01.2044	755.874	0,11
1.250.000	Trust Fibra Uno 'REGS'	6,39 %	15.01.2050	981.887	0,14
				52.502.376	7,44
Mexiko insgesamt					
Marokko (30. Juni 2022: 0,42 %)					
900.000	OCP SA 'REGS'	4,50 %	22.10.2025	870.057	0,12

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Marokko (30. Juni 2022: 0,42 %) (Fortsetzung)					
1.706.000	OCP SA 'REGS'	3,75 %	23.06.2031	1.409.463	0,20
700.000	OCP SA 'REGS'	6,88 %	25.04.2044	641.599	0,09
1.050.000	OCP SA 'REGS'	5,13 %	23.06.2051	762.941	0,11
Marokko insgesamt				3.684.060	0,52
Niederlande (30. Juni 2022: 5,11 %)					
843.000	Bharti Airtel International Netherlands BV 'REGS'	5,35 %	20.05.2024	837.352	0,12
300.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS'	4,50 %	10.01.2028	275.535	0,04
1.900.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS'	4,50 %	31.01.2030	1.624.405	0,23
1.100.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS'	7,25 %	13.02.2033	1.075.607	0,15
1.500.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS'	5,88 %	31.01.2050	1.210.800	0,17
650.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' FRN	8,50 %	23.01.2081	657.507	0,09
975.000	MEGlobal BV 'REGS'	4,25 %	03.11.2026	934.274	0,13
390.000	MEGlobal BV 'REGS'	2,63 %	28.04.2028	339.534	0,05
1.485.200	Greenko Dutch BV 'REGS'	3,85 %	29.03.2026	1.331.170	0,19
400.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS'	8,00 %	18.09.2027	363.108	0,05
500.000	Metinvest BV 'REGS'	7,75 %	17.10.2029	292.500	0,04
200.000	Petrobras Global Finance BV	7,38 %	17.01.2027	208.016	0,03
1.175.000	Petrobras Global Finance BV	6,00 %	27.01.2028	1.169.383	0,17
680.000	Petrobras Global Finance BV	5,09 %	15.01.2030	633.393	0,09
1.150.000	Petrobras Global Finance BV	5,60 %	03.01.2031	1.096.094	0,15
2.000.000	Petrobras Global Finance BV	6,50 %	03.07.2033	1.957.000	0,28
725.000	Petrobras Global Finance BV	6,88 %	20.01.2040	702.728	0,10
600.000	Petrobras Global Finance BV	6,75 %	27.01.2041	570.876	0,08
1.100.000	Petrobras Global Finance BV	7,25 %	17.03.2044	1.087.119	0,15
1.055.000	Petrobras Global Finance BV	6,90 %	19.03.2049	968.173	0,14
715.000	Petrobras Global Finance BV	5,50 %	10.06.2051	562.705	0,08
1.935.000	Petrobras Global Finance BV	6,85 %	05.06.2115	1.671.318	0,24
3.810.000	Prosus NV '144A'	3,26 %	19.01.2027	3.442.145	0,49
4.856.000	Prosus NV '144A'	3,68 %	21.01.2030	4.064.472	0,58
200.000	Prosus NV '144A'	3,06 %	13.07.2031	155.625	0,02

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögen s
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Niederlande (30. Juni 2022: 5,11 %) (Fortsetzung)					
1.250.000	Prosus NV '144A'	4,03 %	03.08.2050	776.563	0,11
2.750.000	Prosus NV '144A'	3,83 %	08.02.2051	1.672.110	0,24
1.000.000	Prosus NV 'REGS'	3,83 %	08.02.2051	608.040	0,09
800.000	SABIC Capital I BV	2,15 %	14.09.2030	667.984	0,09
650.000	SABIC Capital I BV	3,00 %	14.09.2050	460.889	0,07
1.650.000	SABIC Capital II BV 'REGS'	4,50 %	10.10.2028	1.611.951	0,23
607.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	6,00 %	15.04.2024	600.444	0,08
3.300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	3,15 %	01.10.2026	2.939.062	0,42
750.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	4,75 %	09.05.2027	689.164	0,10
1.300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	6,75 %	01.03.2028	1.275.183	0,18
350.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	5,13 %	09.05.2029	315.525	0,04
2.550.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	4,10 %	01.10.2046	1.659.897	0,23
Niederlande insgesamt				40.507.651	5,74
Nigeria (30. Juni 2022: 0,22 %)					
550.000	Access Bank Plc 'REGS'	6,13 %	21.09.2026	462.847	0,07
800.000	SEPLAT Energy Plc 'REGS'	7,75 %	01.04.2026	671.576	0,09
Nigeria insgesamt				1.134.423	0,16
Oman (30. Juni 2022: 0,17 %)					
800.000	Bank Muscat SAOG 'EMTN'	4,75 %	17.03.2026	773.904	0,11
Oman insgesamt				773.904	0,11
Panama (30. Juni 2022: 0,50 %)					
2.122.823	AES Panama Generation Holdings SRL 'REGS'	4,38 %	31.05.2030	1.812.360	0,26
300.000	Banco General SA 'REGS'	4,13 %	07.08.2027	281.310	0,04
450.000	Telecomunicaciones Digitales SA 'REGS'	4,50 %	30.01.2030	382.158	0,05
Panama insgesamt				2.475.828	0,35

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Netto-vermögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Paraguay (30. Juni 2022: 0,11 %)					
1.152.000	Telefonica Celular del Paraguay SA 'REGS'	5,88 %	15.04.2027	1.056.960	0,15
Paraguay insgesamt				1.056.960	0,15
Peru (30. Juni 2022: 1,15 %)					
773.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS'	2,70 %	11.01.2025	736.862	0,11
700.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS' FRN	3,13 %	01.07.2030	641.599	0,09
550.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS' FRN	3,25 %	30.09.2031	482.158	0,07
324.000	Consortio Transmantaro SA 'REGS'	4,70 %	16.04.2034	298.783	0,04
350.000	Consortio Transmantaro SA 'REGS'	5,20 %	11.04.2038	321.646	0,05
291.200	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru 'REGS'	6,38 %	01.06.2028	279.552	0,04
350.000	InRetail Consumer 'REGS'	3,25 %	22.03.2028	299.670	0,04
850.000	Kallpa Generacion SA 'REGS'	4,13 %	16.08.2027	787.312	0,11
500.000	Minsur SA 'REGS'	4,50 %	28.10.2031	436.563	0,06
Peru insgesamt				4.284.145	0,61
Philippinen (30. Juni 2022: 0,86 %)					
500.000	BDO Unibank Inc 'EMTN'	2,13 %	13.01.2026	459.135	0,07
1.300.000	Globe Telecom Inc FRN (Perpetual)	4,20 %	02.08.2026	1.205.230	0,17
500.000	Manila Water Co Inc	4,38 %	30.07.2030	459.000	0,07
350.000	Petron Corp FRN (Perpetual)	5,95 %	19.04.2026	313.544	0,04
1.200.000	Philippine National Bank 'EMTN'	3,28 %	27.09.2024	1.156.704	0,16
Philippinen insgesamt				3.593.613	0,51
Katar (30. Juni 2022: 0,41 %)					
645.000	Commercial Bank PSQC/The FRN (Perpetual)	4,50 %	03.03.2026	581.680	0,08
587.600	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3 'REGS'	6,33 %	30.09.2027	599.352	0,09
1.321.950	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3 'REGS'	5,84 %	30.09.2027	1.334.086	0,19
Katar insgesamt				2.515.118	0,36

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Netto-vermögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Saudi-Arabien (30. Juni 2022: 0,17 %)					
450.000	Banque Saudi Fransi	4,75 %	31.05.2028	445.752	0,06
600.000	Saudi Telecom Co 'REGS'	3,89 %	13.05.2029	576.828	0,08
Saudi-Arabien insgesamt				1.022.580	0,14
Singapur (30. Juni 2022: 6,00 %)					
1.050.000	BOC Aviation Ltd 'GMTN'	4,00 %	25.01.2024	1.037.479	0,15
900.000	BOC Aviation Ltd 'GMTN'	1,75 %	21.01.2026	814.536	0,12
1.250.000	BOC Aviation Ltd 'GMTN'	4,50 %	23.05.2028	1.206.194	0,17
1.737.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,50 %	10.10.2024	1.679.523	0,24
2.000.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,25 %	29.04.2025	1.903.020	0,27
1.650.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,88 %	27.04.2026	1.569.859	0,22
950.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,50 %	18.09.2027	886.749	0,13
1.800.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,00 %	11.09.2029	1.584.000	0,22
300.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	2,63 %	17.09.2030	256.671	0,04
950.000	BPRL International Singapore Pte Ltd 'EMTN'	4,38 %	18.01.2027	905.198	0,13
186.000	Continuum Energy Levanter Pte Ltd 'REGS'	4,50 %	09.02.2027	172.329	0,02
400.000	COSL Singapore Capital Ltd 'EMTN'	4,50 %	30.07.2025	389.788	0,05
1.200.000	DBS Group Holdings Ltd 'GMTN' FRN	1,82 %	10.03.2031	1.075.152	0,15
1.725.000	DBS Group Holdings Ltd 'GMTN' FRN (Perpetual)	3,30 %	27.02.2025	1.631.005	0,23
500.000	DBS Group Holdings Ltd 'REGS'	1,17 %	22.11.2024	471.840	0,07
600.000	DBS Group Holdings Ltd 'REGS'	1,19 %	15.03.2027	527.148	0,07
1.050.000	DBS Group Holdings Ltd 'REGS' FRN	4,52 %	11.12.2028	1.041.863	0,15
2.050.000	Flex Ltd	4,75 %	15.06.2025	1.999.365	0,28
1.175.000	Flex Ltd	3,75 %	01.02.2026	1.118.694	0,16
1.750.000	Flex Ltd	4,88 %	15.06.2029	1.655.693	0,23
1.920.000	Flex Ltd	4,88 %	12.05.2030	1.858.234	0,26
1.700.000	GLP Pte Ltd 'EMTN'	3,88 %	04.06.2025	1.174.003	0,17
900.000	Medco Oak Tree Pte Ltd 'REGS'	7,38 %	14.05.2026	884.529	0,13
1.100.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd FRN	4,60 %	15.06.2032	1.063.898	0,15
1.700.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 'REGS'	4,25 %	19.06.2024	1.670.981	0,24
1.850.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 'REGS' FRN	1,83 %	10.09.2030	1.682.630	0,24

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Netto-vermögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Singapur (30. Juni 2022: 6,00 %)					
300.000	Singapore Airlines Ltd 'EMTN'	3,00 %	20.07.2026	279.609	0,04
300.000	Singapore Airlines Ltd 'EMTN'	3,38 %	19.01.2029	275.571	0,04
1.000.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	3,25 %	30.06.2025	960.580	0,14
350.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	2,38 %	03.10.2026	319.455	0,04
300.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	3,88 %	28.08.2028	285.831	0,04
350.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	2,38 %	28.08.2029	301.710	0,04
600.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	1,88 %	10.06.2030	498.594	0,07
1.250.000	United Overseas Bank Ltd 'EMTN' FRN (Perpetual)	3,88 %	19.10.2023	1.232.225	0,17
1.050.000	United Overseas Bank Ltd 'GMTN' FRN	1,75 %	16.03.2031	932.883	0,13
1.178.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS'	3,06 %	07.04.2025	1.133.872	0,16
1.250.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS'	1,25 %	14.04.2026	1.121.850	0,16
1.550.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN	3,75 %	15.04.2029	1.519.682	0,22
350.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN	2,00 %	14.10.2031	307.041	0,04
1.672.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN	3,86 %	07.10.2032	1.559.541	0,22
650.000	Vena Energy Capital Pte Ltd 'EMTN'	3,13 %	26.02.2025	610.565	0,09
Singapur insgesamt				41.599.390	5,89
Südafrika (30. Juni 2022: 0,19 %)					
1.270.000	Absa Group Ltd FRN (Perpetual)	6,38 %	27.05.2026	1.170.127	0,17
Südafrika insgesamt				1.170.127	0,17
Spanien (30. Juni 2022: 0,38 %)					
1.820.000	AI Candelaria Spain SA 'REGS'	5,75 %	15.06.2033	1.352.296	0,19
1.800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN	5,86 %	14.09.2026	1.773.472	0,25
1.200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN	6,14 %	14.09.2028	1.199.737	0,17
560.000	EnfraGen Energia Sur SA / EnfraGen Spain SA / Prime Energia SpA 'REGS'	5,38 %	30.12.2030	365.400	0,05
Spanien insgesamt				4.690.905	0,66
Thailand (30. Juni 2022: 2,02 %)					
1.475.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS'	4,05 %	19.03.2024	1.454.542	0,21
650.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS'	4,30 %	15.06.2027	631.150	0,09

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Netto-vermögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Thailand (30. Juni 2022: 2,02 %) (Fortsetzung)					
1.500.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN	3,73 %	25.09.2034	1.277.745	0,18
1.200.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN	3,47 %	23.09.2036	976.884	0,14
200.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN (Perpetual)	5,00 %	23.09.2025	189.676	0,03
1.400.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS'	2,98 %	18.03.2031	1.157.548	0,16
1.812.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS'	4,40 %	30.03.2032	1.642.650	0,23
900.000	Kasikornbank PCL/Hong Kong	5,46 %	07.03.2028	902.538	0,13
1.300.000	Kasikornbank PCL/Hong Kong 'EMTN' FRN	3,34 %	02.10.2031	1.147.900	0,16
550.000	Krung Thai Bank PCL/Cayman Islands FRN (Perpetual)	4,40 %	25.03.2026	504.686	0,07
500.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd 'REGS'	2,59 %	10.06.2027	454.770	0,06
1.200.000	Siam Commercial Bank PCL/Cayman Islands 'GMTN'	3,90 %	11.02.2024	1.184.568	0,17
550.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS'	5,38 %	20.11.2048	468.446	0,07
600.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS'	3,50 %	17.10.2049	381.312	0,05
900.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS'	3,75 %	18.06.2050	597.672	0,09
Thailand insgesamt				12.972.087	1,84
Türkei (30. Juni 2022: 2,91 %)					
383.000	Akbank TAS 'REGS'	6,80 %	06.02.2026	363.996	0,05
850.000	Akbank TAS 'REGS' FRN	6,80 %	22.06.2031	770.440	0,11
200.000	Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS 'REGS'	3,38 %	29.06.2028	160.956	0,02
350.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS'	7,75 %	02.02.2027	294.836	0,04
300.000	Coca-Cola Icecek AS 'REGS'	4,50 %	20.01.2029	266.343	0,04
350.000	QNB Finansbank AS 'REGS'	6,88 %	07.09.2024	347.354	0,05
750.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS'	4,88 %	19.06.2024	711.990	0,10
1.200.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS'	6,88 %	28.02.2025	1.135.164	0,16
350.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS 'REGS'	5,80 %	11.04.2028	309.939	0,04
934.000	Türkiye Garanti Bankasi AS 'REGS' FRN	7,18 %	24.05.2027	852.705	0,12
350.000	Türkiye Is Bankasi AS FRN	7,75 %	22.01.2030	327.446	0,05
1.825.000	Türkiye Is Bankasi AS 'REGS'	6,13 %	25.04.2024	1.783.773	0,25
1.300.000	Türkiye Petrol Rafinerileri AS 'REGS'	4,50 %	18.10.2024	1.240.265	0,18
850.000	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS 'REGS'	6,95 %	14.03.2026	823.395	0,12
875.000	Türkiye Vakiflar Bankasi TAO 'REGS'	8,13 %	28.03.2024	868.061	0,12

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Netto-vermögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Türkei (30. Juni 2022: 2,91 %)					
2.316.000	Türkiye Vakıflar Bankasi TAO 'REGS'	6,50 %	08.01.2026	2.148.414	0,30
1.549.000	Ulker Biskuvi Sanayi AS 'REGS'	6,95 %	30.10.2025	1.386.990	0,20
650.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS'	5,85 %	21.06.2024	631.501	0,09
700.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS'	8,25 %	15.10.2024	693.196	0,10
Türkei insgesamt				15.116.764	2,14
Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2022: 2,35 %)					
650.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	3,50 %	31.03.2027	613.841	0,09
1.062.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 'GMTN'	4,50 %	14.09.2027	1.041.450	0,15
750.000	Commercial Bank Of Dubai Psc 5.319% 14/06/28	5,32 %	14.06.2028	747.188	0,11
650.000	Commercial Bank of Dubai PSC FRN (Perpetual)	6,00 %	21.04.2026	632.177	0,09
1.000.000	Emirates NBD Bank PJSC	1,64 %	13.01.2026	914.300	0,13
550.000	Emirates NBD Bank PJSC 'EMTN'	2,63 %	18.02.2025	523.903	0,07
1.350.000	Emirates NBD Bank PJSC FRN (Perpetual)	6,13 %	20.03.2025	1.334.812	0,19
620.000	Emirates NBD Bank PJSC FRN (Perpetual)	6,13 %	09.04.2026	612.058	0,09
900.000	Emirates NBD Bank PJSC FRN (Perpetual)	4,25 %	27.02.2027	797.418	0,11
500.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 'EMTN'	5,13 %	13.10.2027	505.480	0,07
1.100.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 'EMTN'	4,38 %	24.04.2028	1.072.269	0,15
1.200.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 'EMTN'	4,77 %	06.06.2028	1.189.500	0,17
1.200.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 'EMTN' FRN	6,44 %	08.07.2024	1.197.612	0,17
1.000.000	First Abu Dhabi Bank PJSC FRN (Perpetual)	4,50 %	05.04.2026	938.290	0,13
201.000	Mashreqbank PSC FRN	7,88 %	24.02.2033	208.933	0,03
600.000	NBK SPC Ltd 'REGS' FRN	1,63 %	15.09.2027	534.084	0,08
800.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)	4,50 %	27.08.2025	733.008	0,10
700.000	NBK Tier 1 Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)	3,63 %	24.08.2026	604.324	0,08
450.000	Oztel Holdings SPC Ltd 'REGS'	6,63 %	24.04.2028	465.214	0,07
194.716	Sweihaan PV Power Co PJSC 'REGS'	3,63 %	31.01.2049	156.450	0,02
1.200.000	Tabreed Sukuk Spc Ltd	5,50 %	31.10.2025	1.200.648	0,17
Vereinigte Arabische Emirate insgesamt				16.022.959	2,27

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Netto-vermögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 1,56 %)					
800.000	Allwyn Entertainment Financing UK Plc 'REGS'	7,88 %	30.04.2029	808.912	0,11
700.000	Anglo American Capital Plc '144A'	4,75 %	10.04.2027	676.655	0,10
1.200.000	Anglo American Capital Plc '144A'	2,25 %	17.03.2028	1.025.112	0,15
2.000.000	Anglo American Capital Plc '144A'	2,63 %	10.09.2030	1.640.560	0,23
1.200.000	Anglo American Capital Plc '144A'	2,88 %	17.03.2031	990.324	0,14
2.250.000	Anglo American Capital Plc '144A'	5,50 %	02.05.2033	2.190.465	0,31
1.400.000	Anglo American Capital Plc '144A'	3,95 %	10.09.2050	1.035.146	0,15
1.700.000	Anglo American Capital Plc '144A'	4,75 %	16.03.2052	1.387.421	0,20
1.750.000	Antofagasta Plc 'REGS'	2,38 %	14.10.2030	1.418.182	0,20
1.900.000	Avianca Midco 2 Plc 'REGS'	9,00 %	01.12.2028	1.586.500	0,22
1.600.000	Bidvest Group UK Plc/The 'REGS'	3,63 %	23.09.2026	1.424.368	0,20
1.400.000	Fresnillo Plc 'REGS'	4,25 %	02.10.2050	1.041.768	0,15
200.000	Liquid Telecommunications Financing Plc 'REGS'	5,50 %	04.09.2026	110.880	0,02
450.000	MARB BondCo Plc 'REGS'	3,95 %	29.01.2031	320.625	0,05
1.820.000	Prudential Funding Asia Plc	3,13 %	14.04.2030	1.603.729	0,23
230.000	Prudential Funding Asia Plc 'EMTN' (Perpetual)	4,88 %	20.10.2023	200.013	0,03
696.000	Prudential Funding Asia Plc 'EMTN' FRN	2,95 %	03.11.2033	587.285	0,08
250.000	Standard Chartered Plc '144A'	4,30 %	19.02.2027	233.900	0,03
2.500.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	7,78 %	16.11.2025	2.551.525	0,36
3.870.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	2,61 %	12.01.2028	3.423.712	0,48
1.600.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	7,77 %	16.11.2028	1.691.760	0,24
3.000.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	2,68 %	29.06.2032	2.344.455	0,33
600.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	4,87 %	15.03.2033	542.400	0,08
3.800.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	3,27 %	18.02.2036	2.970.498	0,42
2.000.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN	6,17 %	09.01.2027	1.994.900	0,28
5.000.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN	6,30 %	09.01.2029	5.022.100	0,71
1.500.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN	3,60 %	12.01.2033	1.198.140	0,17
500.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN (Perpetual)	6,00 %	26.07.2025	474.430	0,07
300.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN (Perpetual)	7,75 %	15.08.2027	294.000	0,04
500.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN (Perpetual)	4,75 %	14.01.2031	360.550	0,05
650.000	Tullow Oil Plc 'REGS'	7,00 %	01.03.2025	394.563	0,06

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Netto-vermögens
Unternehmensanleihen (30. Juni 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 1,56 %) (Fortsetzung)					
1.220.000	Tullow Oil Plc 'REGS'	10,25 %	15.05.2026	928.420	0,13
Vereinigtes Königreich insgesamt				42.473.298	6,02
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 3,60 %)					
650.000	Bimbo Bakeries USA Inc 'REGS'	4,00 %	17.05.2051	520.812	0,07
1.600.000	BOC Aviation USA Corp 'REGS'	1,63 %	29.04.2024	1.542.008	0,22
250.000	Braskem America Finance Co 'REGS'	7,13 %	22.07.2041	240.505	0,04
400.000	GUSAP III LP 'REGS'	4,25 %	21.01.2030	368.750	0,05
1.000.000	Hikma Finance USA LLC	3,25 %	09.07.2025	946.340	0,14
650.000	Kosmos Energy Ltd 'REGS'	7,13 %	04.04.2026	570.804	0,08
300.000	MercadoLibre Inc	3,13 %	14.01.2031	237.975	0,03
500.000	NBM US Holdings Inc 'REGS'	7,00 %	14.05.2026	485.795	0,07
1.200.000	Periama Holdings LLC/DE	5,95 %	19.04.2026	1.151.340	0,16
500.000	SK Battery America Inc	2,13 %	26.01.2026	439.450	0,06
700.000	Stillwater Mining Co 'REGS'	4,00 %	16.11.2026	621.292	0,09
650.000	Stillwater Mining Co 'REGS'	4,50 %	16.11.2029	525.083	0,08
420.000	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC	6,15 %	01.02.2036	370.604	0,05
1.399.000	TSMC Arizona Corp	1,75 %	25.10.2026	1.244.383	0,18
1.933.000	TSMC Arizona Corp	3,88 %	22.04.2027	1.853.322	0,26
2.050.000	TSMC Arizona Corp	2,50 %	25.10.2031	1.710.746	0,24
1.250.000	TSMC Arizona Corp	4,25 %	22.04.2032	1.201.925	0,17
1.100.000	TSMC Arizona Corp	3,13 %	25.10.2041	873.900	0,12
650.000	TSMC Arizona Corp	3,25 %	25.10.2051	493.142	0,07
2.600.000	TSMC Arizona Corp	4,50 %	22.04.2052	2.466.958	0,35
1.850.000	Wipro IT Services LLC 'REGS'	1,50 %	23.06.2026	1.644.724	0,23
Vereinigte Staaten insgesamt				19.509.858	2,76
Unternehmensanleihen insgesamt				680.019.030	96,33

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Netto-vermögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 1,36 %)					
Korea, Republik (Südkorea) (30. Juni 2022: 1,36 %)					
1.600.000	Industrial Bank of Korea 'REGS'	0,63 %	17.09.2024	1.506.672	0,21
1.300.000	Industrial Bank of Korea 'REGS'	1,04 %	22.06.2025	1.189.786	0,17
1.150.000	Korea Electric Power Corp 'REGS'	5,38 %	06.04.2026	1.145.733	0,16
1.000.000	Korea Expressway Corp 'REGS'	3,63 %	18.05.2025	965.400	0,14
1.022.000	Korea Expressway Corp 'REGS'	1,13 %	17.05.2026	906.167	0,13
1.200.000	Korea Gas Corp 'REGS'	3,88 %	12.02.2024	1.186.392	0,17
1.200.000	Korea Gas Corp 'REGS'	3,50 %	21.07.2025	1.153.740	0,16
1.250.000	Korea Gas Corp 'REGS'	3,50 %	02.07.2026	1.180.663	0,17
1.400.000	Korea Gas Corp 'REGS'	3,88 %	13.07.2027	1.344.294	0,19
500.000	Korea Gas Corp 'REGS'	4,88 %	05.07.2028	497.905	0,07
850.000	Korea Gas Corp 'REGS'	2,88 %	16.07.2029	756.713	0,11
1.900.000	Korea Gas Corp 'REGS'	6,25 %	20.01.2042	2.192.277	0,31
550.000	Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd 'REGS'	1,25 %	27.04.2026	489.362	0,07
1.100.000	Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd 'REGS'	4,25 %	27.07.2027	1.070.014	0,15
Korea, Republik (Südkorea) insgesamt				15.585.118	2,21
Staatsanleihe insgesamt				15.585.118	2,21
Gesamtanlagen					
Unternehmensanleihen				680.019.030	96,33
Staatsanleihe				15.585.118	2,21
Anzahl der Kontrakte	Käufe	Verkäufe	Fälligkeit	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Netto-vermögens
Devisenterminkontrakte¹					
5	1.763.672 USD	(1.575.925) CHF	06.07.2023	1.759	0,00
4	1.681.773 USD	(1.538.413) EUR	06.07.2023	3.176	0,00
3	6.892.591 GBP	(8.533.168) USD	06.07.2023	229.868	0,03
2	173.487.709 EUR	(185.595.532) USD	06.07.2023	3.701.024	0,53
9	266.337.809 CHF	(293.680.077) USD	06.07.2023	4.090.487	0,58
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (30. Juni 2022: 0,04 %)				8.026.314	1,14

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Anzahl der Kontrakte	Käufe	Verkäufe	Fälligkeit	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettovermögens
Devisenterminkontrakte¹ (Fortsetzung)					
1	64.929 GBP	(83.262) USD	07.06.2023	(714)	(0,00)
4	1.904.773 CHF	(2.132.202) USD	07.06.2023	(2.631)	(0,00)
2	635.436 USD	(507.732) GBP	07.06.2023	(10.078)	(0,00)
4	9.906.527 USD	(9.237.450) EUR	07.06.2023	(172.674)	(0,03)
5	24.659.675 USD	(22.300.652) CHF	07.06.2023	(272.864)	(0,04)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (30. Juni 2022: (0,85) %)				(458.961)	(0,07)
Gesamtanlagen					
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				2.779.562	0,39
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen				705.951.063	100,00
Analyse des Gesamtvermögens					% des Gesamtvermögens
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					97,22
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente					1,12
Sonstige Vermögenswerte					1,66
					100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

*In den sonstigen Vermögenswerten sind Anteile am LGIM Dollar Liquidity Fund mit einem Wert von 762.850 US\$ enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

¹ Der Kontrahent für die Devisenterminkontrakte ist die Bank of New York Mellon.

L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,65 %)			
Kanada (30. Juni 2022: 3,78 %)			
5.662.183	Ballard Power Systems Inc	24.687.118	4,62
1.569.528	Xebec Adsorption Inc*	–	–
Kanada insgesamt		24.687.118	4,62
China (30. Juni 2022: 5,35 %)			
17.002.723	Weichai Power Co Ltd 'H'	24.907.675	4,66
China insgesamt		24.907.675	4,66
Dänemark (30. Juni 2022: 4,44 %)			
279.567	Orsted AS '144A'	26.412.924	4,94
Dänemark insgesamt		26.412.924	4,94
Frankreich (30. Juni 2022: 5,08 %)			
138.921	Air Liquide SA	24.886.764	4,66
Frankreich insgesamt		24.886.764	4,66
Deutschland (30. Juni 2022: 7,29 %)			
117.957	SFC Energy AG	2.927.740	0,55
1.022.058	Siemens Energy AG	18.041.865	3,38
Deutschland insgesamt		20.969.605	3,93
Irland (30. Juni 2022: 4,16 %)			
67.741	Linde Plc	25.814.740	4,83
Irland insgesamt		25.814.740	4,83
Italien (30. Juni 2022: – %)			
371.369	Industrie De Nora SpA	7.791.343	1,46
Italien insgesamt		7.791.343	1,46

L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,65 %) (Fortsetzung)			
Japan (30. Juni 2022: 12,29 %)			
479.011	Kyocera Corp	25.820.557	4,83
1.395.841	Nippon Sanso Holdings Corp	30.054.011	5,63
1.834.063	Toyota Motor Corp	29.293.485	5,48
	Japan insgesamt	85.168.053	15,94
Norwegen (30. Juni 2022: 3,92 %)			
3.485.901	Aker Horizons ASA	2.209.279	0,41
13.461.796	NEL ASA	15.819.561	2,96
	Norwegen insgesamt	18.028.840	3,37
Südkorea (30. Juni 2022: 10,97 %)			
1.119.629	Doosan Fuel Cell Co Ltd	24.386.864	4,56
169.504	Hyundai Motor Co	26.564.395	4,97
318.202	Kolon Industries Inc	12.062.528	2,26
	Südkorea insgesamt	63.013.787	11,79
Schweden (30. Juni 2022: 3,37 %)			
858.396	PowerCell Sweden AB	6.670.809	1,25
	Schweden insgesamt	6.670.809	1,25
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 10,20 %)			
1.380.235	Ceres Power Holdings Plc	5.327.457	1,00
6.592.285	ITM Power Plc	6.057.860	1,13
1.014.086	Johnson Matthey Plc	22.510.449	4,21
	Vereinigtes Königreich insgesamt	33.895.766	6,34
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 28,80 %)			
85.021	Air Products and Chemicals Inc	25.466.340	4,77
1.503.115	Bloom Energy Corp - Class A	24.575.930	4,60

L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,65 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 28,80 %) (Fortsetzung)			
860.917	Chemours Co/The	31.759.228	5,94
106.479	Cummins Inc	26.104.392	4,88
13.353.747	FuelCell Energy Inc	28.844.093	5,40
4.345.375	Hyzon Motors Inc	4.165.042	0,78
2.771.522	Plug Power Inc	28.796.114	5,39
Vereinigte Staaten insgesamt		169.711.139	31,76
Stammaktien insgesamt		531.958.563	99,55
Gesamtanlagen			
Stammaktien		531.958.563	99,55
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		2.430.935	0,45
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		534.389.498	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,51
Sonstige Vermögenswerte			0,49
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

*Dieses Wertpapier wurde mit null bewertet.

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 97,02 %)			
Österreich (30. Juni 2022: 4,21 %)			
5.423	ANDRITZ AG	276.844	0,95
10.001	Erste Group Bank AG	320.932	1,10
8.062	OMV AG	313.128	1,07
787	Porr Ag	10.200	0,03
220	Strabag SE	8.195	0,03
8.186	UNIQA Insurance Group AG	60.167	0,21
Österreich insgesamt		989.466	3,39
Belgien (30. Juni 2022: 2,67 %)			
8.450	Ageas SA/NV	313.580	1,07
8.254	Econocom Group SA/NV	21.914	0,08
Belgien insgesamt		335.494	1,15
Dänemark (30. Juni 2022: 2,17 %)			
167	AP Moller - Maersk A/S - Class B	268.578	0,92
6.028	Spar Nord Bank A/S	86.381	0,29
4.474	Sydbank AS	189.391	0,65
16.819	Tryg A/S	333.512	1,14
Dänemark insgesamt		877.862	3,00
Finnland (30. Juni 2022: 9,12 %)			
6.159	Elisa Oyj	301.421	1,03
6.660	Kemira Oyj	97.169	0,33
12.741	Metsa Board Oyj	86.129	0,30
31.214	Nordea Bank Abp	311.079	1,07
7.795	Orion Oyj	296.366	1,01
7.313	Sampo Oyj - Class A	300.711	1,03

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 97,02 %) (Fortsetzung)			
Finnland (30. Juni 2022: 9,12 %) (Fortsetzung)			
6.660	TietoEVRY Oyj	168.365	0,58
10.549	UPM-Kymmene Oyj	287.671	0,98
Finnland insgesamt		1.848.911	6,33
Frankreich (30. Juni 2022: 18,15 %)			
2.292	Air Liquide SA	376.346	1,29
12.141	AXA SA	328.111	1,12
5.692	BNP Paribas SA	328.542	1,13
11.285	Bouygues SA	347.127	1,19
12.624	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	341.605	1,17
2.554	Gaztransport Et Technigaz SA	238.160	0,82
4.826	Metropole Television SA	62.641	0,21
30.649	Orange SA	328.006	1,12
4.592	Publicis Groupe SA	337.512	1,16
6.146	Rubis SCA	136.687	0,47
3.881	Sanofi	381.114	1,30
2.375	Schneider Electric SE	395.342	1,35
12.158	SCOR SE	326.929	1,12
6.181	TotalEnergies SE	324.812	1,11
1.137	Vicat SA	33.087	0,11
Frankreich insgesamt		4.286.021	14,67
Deutschland (30. Juni 2022: 6,37 %)			
1.533	Allianz SE	326.836	1,12
7.443	BASF SE	330.990	1,13
3.357	Bayerische Motoren Werke AG	377.730	1,29
15.066	Evonik Industries AG	262.600	0,90
1.907	Hannover Rueck SE	370.625	1,27

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 97,02 %) (Fortsetzung)			
Deutschland (30. Juni 2022: 6,37 %) (Fortsetzung)			
5.578	Heidelberg Materials AG	419.466	1,44
1.708	HOCHTIEF AG	135.273	0,46
4.906	Mercedes-Benz Group AG	361.425	1,24
1.049	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	360.436	1,23
2.399	Siemens AG	365.943	1,25
2.442	Takkt AG	33.993	0,12
4.127	Talanx AG	216.874	0,74
2.053	Wacker Neuson SE	45.577	0,16
Deutschland insgesamt		3.607.768	12,35
Italien (30. Juni 2022: 10,42 %)			
121.709	A2A SpA	203.619	0,70
3.152	ACEA SpA	37.761	0,13
19.321	Assicurazioni Generali SpA	359.757	1,23
8.463	Azimut Holding SpA	167.187	0,57
4.463	Banca Generali SpA	140.585	0,48
1.775	Banca IFIS SpA	26.022	0,09
19.146	Banca Mediolanum SpA	158.567	0,54
30.730	Banca Popolare di Sondrio SPA	117.266	0,40
83.439	BPER Banca	232.127	0,79
68.447	Enel SpA	422.181	1,45
146.691	Intesa Sanpaolo SpA	352.058	1,21
53.156	Iren SpA	90.418	0,31
35.810	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	392.478	1,34
12.288	Piaggio & C SpA	46.694	0,16
7.828	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	342.475	1,17
52.317	Terna - Rete Elettrica Nazionale	408.387	1,40

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 97,02 %) (Fortsetzung)			
Italien (30. Juni 2022: 10,42 %) (Fortsetzung)			
33.528	Unipol Gruppo SpA	163.985	0,56
31.631	UnipolSai Assicurazioni SpA	71.802	0,25
Italien insgesamt		3.733.369	12,78
Liechtenstein (30. Juni 2022: 0,07 %)			
171	VP Bank AG	14.786	0,05
Liechtenstein insgesamt		14.786	0,05
Luxemburg (30. Juni 2022: – %)			
3.582	APERAM SA	102.374	0,35
Luxemburg insgesamt		102.374	0,35
Niederlande (30. Juni 2022: 3,63 %)			
4.880	BE Semiconductor Industries NV	484.584	1,66
28.383	ING Groep NV	350.190	1,20
2.967	Koninklijke DSM NV	271.391	0,93
20.491	MFE-MediaForEurope NV	14.395	0,05
6.446	Randstad NV	311.406	1,06
Niederlande insgesamt		1.431.966	4,90
Norwegen (30. Juni 2022: 7,97 %)			
18.062	DNB Bank ASA	310.135	1,06
13.211	Gjensidige Forsikring ASA	194.177	0,66
19.053	Leroy Seafood Group ASA	66.376	0,23
22.541	Mowi ASA	328.225	1,12
53.779	Norsk Hydro ASA	293.543	1,01
8.265	SpareBank 1 SMN	99.701	0,34
13.816	SpareBank 1 SR-Bank ASA	153.779	0,53

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 97,02 %) (Fortsetzung)			
Norwegen (30. Juni 2022: 7,97 %) (Fortsetzung)			
33.991	Telenor ASA	316.396	1,08
8.063	Veidekke ASA	79.329	0,27
8.339	Yara International ASA	270.391	0,93
Norwegen insgesamt		2.112.052	7,23
Polen (30. Juni 2022: 1,37 %)			
4.188	Asseco Poland SA	75.820	0,26
1.927	Ciech SA	23.258	0,08
26.223	ORLEN SA	381.039	1,30
1.959	Warsaw Stock Exchange	16.821	0,06
Polen insgesamt		496.938	1,70
Portugal (30. Juni 2022: 2,60 %)			
5.339	Altri SGPS SA	22.221	0,07
78.402	EDP - Energias de Portugal SA	350.927	1,20
6.362	NOS SGPS SA	20.714	0,07
18.557	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	46.300	0,16
67.296	Sonae SGPS SA	60.634	0,21
Portugal insgesamt		500.796	1,71
Spanien (30. Juni 2022: 6,66 %)			
15.319	Acerinox SA	148.962	0,51
11.755	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	378.158	1,29
5.171	Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	18.057	0,06
55.390	Bankinter SA	311.846	1,07
4.220	Ebro Foods SA	68.195	0,23
20.043	Enagas SA	360.774	1,24
30.759	Iberdrola SA	367.570	1,26

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 97,02 %) (Fortsetzung)			
Spanien (30. Juni 2022: 6,66 %) (Fortsetzung)			
75.930	Mapfre SA	138.117	0,47
23.692	Redeia Corp SA	364.502	1,25
Spanien insgesamt		2.156.181	7,38
Schweden (30. Juni 2022: 8,51 %)			
31.454	Atlas Copco AB	414.783	1,42
9.524	Boliden AB	251.792	0,86
3.096	Clas Ohlson AB	21.254	0,07
5.440	Loomis AB - Class B	145.228	0,50
14.855	Peab AB	54.003	0,19
19.267	Sandvik AB	343.670	1,18
1.475	Skandinaviska Enskilda Banken AB	15.771	0,05
31.525	Skandinaviska Enskilda Banken AB	318.745	1,09
19.249	Swedbank AB	297.041	1,02
19.796	Volvo AB	374.608	1,28
Schweden insgesamt		2.236.895	7,66
Schweiz (30. Juni 2022: 13,10 %)			
2.389	Baloise Holding AG	321.615	1,10
2.147	Banque Cantonale Vaudoise	207.868	0,71
2.291	Cembra Money Bank AG	174.162	0,60
3.105	DSM-Firmenich AG	306.215	1,05
5.865	EFG International AG	54.561	0,19
2.729	Helvetia Holding AG	338.309	1,16
6.180	Holcim Ltd	381.162	1,30
785	Leonteq AG	32.894	0,11
1.290	Roche Holding AG	361.469	1,24
1.522	Sulzer AG	119.913	0,41

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 97,02 %) (Fortsetzung)			
Schweiz (30. Juni 2022: 13,10 %) (Fortsetzung)			
659	Swiss Life Holding AG	353.111	1,21
3.391	Swiss Re AG	312.815	1,07
18.266	UBS Group AG	338.631	1,16
1.175	Valiant Holding AG	112.196	0,38
752	Zurich Insurance Group AG	327.363	1,12
Schweiz insgesamt		3.742.284	12,81
Stammaktien insgesamt		28.473.163	97,46
Vorzugsaktien (30. Juni 2022: 2,71 %)			
Deutschland (30. Juni 2022: 2,71 %)			
4.118	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	429.096	1,47
5.320	FUCHS SE - Preference	192.690	0,66
Deutschland insgesamt		621.786	2,13
Vorzugsaktien insgesamt		621.786	2,13
Gesamtanlagen			
Stammaktien		28.473.163	97,46
Vorzugsaktien		621.786	2,13
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		119.333	0,41
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		29.214.282	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,57
Sonstige Vermögenswerte			0,43
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 94,87 %)			
Australien (30. Juni 2022: 30,53 %)			
46.559	Accent Group Ltd	51.913	0,24
16.871	Ampol Ltd	336.238	1,58
54.754	APA Group	353.178	1,66
8.252	ASX Ltd	346.062	1,62
172.220	Aurizon Holdings Ltd	449.391	2,11
32.854	Australian Finance Group Ltd	39.147	0,18
7.984	Brickworks Ltd	141.689	0,66
27.447	Fortescue Metals Group Ltd	405.239	1,90
77.823	Harvey Norman Holdings Ltd	180.278	0,84
20.781	IPH Ltd	108.313	0,51
27.434	IRESS Ltd	187.183	0,88
13.291	JB Hi-Fi Ltd	387.071	1,81
3.109	Macquarie Group Ltd	367.593	1,72
19.514	Magellan Financial Group Ltd	123.273	0,58
8.680	McMillan Shakespeare Ltd	104.350	0,49
163.650	Medibank Pvt Ltd	383.454	1,80
135.935	Metcash Ltd	340.231	1,59
6.495	Mineral Resources Ltd	308.826	1,45
6.807	Nick Scali Ltd	41.279	0,19
209.429	Nine Entertainment Co Holdings Ltd	273.939	1,28
126.724	Orora Ltd	277.530	1,30
12.274	Premier Investments Ltd	165.531	0,78
5.001	Rio Tinto Ltd	381.801	1,79
11.730	SmartGroup Corp Ltd	61.841	0,29
33.904	Solvar Ltd	34.868	0,16
17.699	Sonic Healthcare Ltd	419.070	1,96
24.624	Super Retail Group Ltd	187.352	0,88
15.335	Woodside Energy Group Ltd	351.562	1,65
Australien insgesamt		6.808.202	31,90
Bermuda (30. Juni 2022: 4,27 %)			
71.000	CK Infrastructure Holdings Ltd	375.540	1,76
308.780	First Pacific Co Ltd	106.780	0,50

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 94,87 %) (Fortsetzung)			
Bermuda (30. Juni 2022: 4,27 %) (Fortsetzung)			
49.000	Luk Fook Holdings International Ltd	125.367	0,59
216.400	Man Wah Holdings Ltd	144.421	0,68
24.804	VTech Holdings Ltd	162.689	0,76
	Bermuda insgesamt	914.797	4,29
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 11,63 %)			
54.000	Asia Cement China Holdings Corp	26.667	0,12
98.576	HKBN Ltd	53.083	0,25
163.000	SITC International Holdings Co Ltd	297.438	1,39
44.723	Texhong International Group Ltd	29.448	0,14
113.118	Value Partners Group Ltd	35.654	0,17
203.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	316.030	1,48
	Cayman-Inseln insgesamt	758.320	3,55
Hongkong (30. Juni 2022: 8,63 %)			
234.000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	89.580	0,42
396.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	342.103	1,60
435.447	Lenovo Group Ltd	453.973	2,13
618.000	PCCW Ltd	320.175	1,50
70.500	Power Assets Holdings Ltd	369.296	1,73
48.000	Swire Pacific Ltd	367.813	1,72
125.000	Swire Pacific Ltd	157.435	0,74
	Hongkong insgesamt	2.100.375	9,84
Neuseeland (30. Juni 2022: 9,02 %)			
62.547	Chorus Ltd	322.843	1,51
83.216	Contact Energy Ltd	412.959	1,94
113.674	Fletcher Building Ltd	377.464	1,77
69.860	Heartland Group Holdings Ltd	72.760	0,34
114.780	Meridian Energy Ltd	393.795	1,85
14.447	Scales Corp Ltd	27.881	0,13
119.157	Spark New Zealand Ltd	371.581	1,74
40.133	Vector Ltd	98.597	0,46
	Neuseeland insgesamt	2.077.880	9,74

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 94,87 %) (Fortsetzung)			
Singapur (30. Juni 2022: 8,54 %)			
34.100	Bumitama Agri Ltd	13.858	0,06
14.811	DBS Group Holdings Ltd	344.840	1,61
63.700	First Resources Ltd	65.424	0,31
514.630	Keppel Infrastructure Trust (Units)	193.933	0,91
40.300	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	365.669	1,71
73.821	Riverstone Holdings Ltd	33.819	0,16
148.900	Singapore Technologies Engineering Ltd	404.881	1,90
17.000	United Overseas Bank Ltd	351.716	1,65
29.474	Venture Corp Ltd	320.359	1,50
	Singapur insgesamt	2.094.499	9,81
Südkorea (30. Juni 2022: 22,25 %)			
43.580	BNK Financial Group Inc	229.203	1,07
3.666	Daishin Securities Co Ltd	37.560	0,18
6.305	DB Insurance Co Ltd	356.964	1,67
18.893	DGB Financial Group Inc	104.240	0,49
7.609	GS Holdings Corp	211.642	0,99
11.554	Hana Financial Group Inc	343.731	1,61
800	HL Holdings Corp	22.464	0,10
1.072	Hyosung Corp	51.418	0,24
604	Hyundai Home Shopping Network Corp	20.994	0,10
8.583	Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	202.256	0,95
2.358	iMarketKorea Inc	17.699	0,08
37.689	Industrial Bank of Korea	295.757	1,39
10.212	KB Financial Group Inc	370.070	1,73
3.232	Korea Gas Corp	63.038	0,30
5.420	Korea Investment Holdings Co Ltd	212.251	0,99
12.901	Korean Reinsurance Co	68.634	0,32
1.648	KT Skylife Co Ltd	8.030	0,04
5.909	KT&G Corp	371.316	1,74
2.401	Kumho Petrochemical Co Ltd	241.804	1,13
30.065	LG Uplus Corp	244.828	1,15
3.363	LX INTERNATIONAL CORP	92.009	0,43

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 94,87 %) (Fortsetzung)			
Südkorea (30. Juni 2022: 22,25 %) (Fortsetzung)			
18.217	NH Investment & Securities Co Ltd	132.032	0,62
273	Samchully Co Ltd	22.459	0,10
4.037	Samsung Card Co Ltd	90.841	0,43
2.382	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	415.786	1,95
8.733	Samsung Securities Co Ltd	238.597	1,12
13.370	Shinhan Financial Group Co Ltd	344.993	1,62
2.736	TKG Huchems Co Ltd	45.889	0,21
42.930	Woori Financial Group Inc	384.127	1,80
Südkorea insgesamt		5.240.632	24,55
Stammaktien insgesamt		19.994.705	93,68
Vorzugsaktien (30. Juni 2022: 4,71 %)			
Südkorea (30. Juni 2022: 4,71 %)			
1.403	Amorepacific Corp - Preference	33.540	0,16
152	CJ CheilJedang Corp - Preference	15.642	0,07
5.045	Hyundai Motor Co - Preference	420.018	1,97
3.082	Hyundai Motor Co - Preference	254.485	1,19
1.091	LG Chem Ltd - Preference	291.452	1,37
2.346	LG Electronics Inc - Preference	97.034	0,45
284	LG H&H Co Ltd - Preference	40.413	0,19
16.415	Mirae Asset Securities Co Ltd - Preference	46.343	0,22
349	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd - Preference	45.398	0,21
Südkorea insgesamt		1.244.325	5,83
Vorzugsaktien insgesamt		1.244.325	5,83
Gesamtanlagen			
Stammaktien		19.994.705	93,68
Vorzugsaktien		1.244.325	5,83
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		103.984	0,49
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		21.343.014	100,00

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,48
Sonstige Vermögenswerte		0,52
		100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

L&G Digital Payments UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,52 %)			
Australien (30. Juni 2022: 2,03 %)			
600.602	Zip Co Ltd	163.917	0,70
Australien insgesamt		163.917	0,70
Kanada (30. Juni 2022: 6,94 %)			
44.521	Lightspeed Commerce Inc	753.995	3,24
18.013	Nuvei Corp '144A'	532.533	2,29
9.771	Shopify Inc - Class A	631.206	2,72
Kanada insgesamt		1.917.734	8,25
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 12,00 %)			
40.859	Dlocal Ltd/Uruguay - Class A	498.684	2,14
46.523	Pageseguro Digital Ltd - Class A	439.177	1,89
43.474	StoneCo Ltd - Class A	553.859	2,38
219.793	Yeahka Ltd	490.823	2,11
Cayman-Inseln insgesamt		1.982.543	8,52
Frankreich (30. Juni 2022: 4,66 %)			
8.762	Edenred	586.374	2,52
13.350	Worldline SA/France '144A'	487.925	2,10
Frankreich insgesamt		1.074.299	4,62
Italien (30. Juni 2022: 2,09 %)			
70.339	Nexi SpA '144A'	551.149	2,37
Italien insgesamt		551.149	2,37
Japan (30. Juni 2022: 4,51 %)			
40.527	Credit Saison Co Ltd	618.132	2,66
7.319	GMO Payment Gateway Inc	567.149	2,44
Japan insgesamt		1.185.281	5,10

L&G Digital Payments UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,52 %) (Fortsetzung)			
Niederlande (30. Juni 2022: 2,43 %)			
353	Adyen NV '144A'	610.732	2,63
Niederlande insgesamt		610.732	2,63
Südkorea (30. Juni 2022: – %)			
13.280	Kakaopay Corp	473.692	2,04
Südkorea insgesamt		473.692	2,04
Vereinigtes Königreich (30. Juni 2022: 4,09 %)			
124.902	Network International Holdings Plc '144A'	609.135	2,62
82.576	Wise Plc - Class A	689.948	2,97
Vereinigtes Königreich insgesamt		1.299.083	5,59
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 58,64 %)			
24.500	ACI Worldwide Inc	567.665	2,44
3.732	American Express Co	650.114	2,79
9.509	Block Inc	633.014	2,72
5.645	Discover Financial Services	659.618	2,84
5.014	Euronet Worldwide Inc	588.493	2,53
69.573	Expensify Inc	555.193	2,39
730	Fair Isaac Corp	590.723	2,54
10.583	Fidelity National Information Services Inc	578.890	2,49
18.972	Flywire Corp	588.891	2,53
5.666	Global Payments Inc	558.214	2,40
32.147	Green Dot Corp - Class A	602.435	2,59
24.677	I3 Verticals Inc - Class A	564.116	2,43
120.226	Marqeta Inc	585.501	2,52
1.524	Mastercard Inc	599.389	2,58
38.228	OneSpan Inc	567.304	2,44
134.573	Payoneer Global Inc	647.296	2,78
9.497	PayPal Holdings Inc	633.735	2,72

L&G Digital Payments UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 99,52 %) (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (30. Juni 2022: 58,64 %) (Fortsetzung)			
20.807	Q2 Holdings Inc	642.936	2,76
32.221	Remitly Global Inc	606.399	2,61
89.787	Repay Holdings Corp - Class A	703.032	3,02
8.830	Shift4 Payments Inc - Class A	599.645	2,58
2.524	Visa Inc - Class A	599.400	2,58
55.280	Zuora Inc	606.422	2,61
Vereinigte Staaten insgesamt		13.928.425	59,89
Stammaktien insgesamt		23.186.855	99,71
Gesamtanlagen			
Stammaktien		23.186.855	99,71
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		68.493	0,29
		23.255.348	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,67
Sonstige Vermögenswerte			0,33
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2022: 94,89 %)					
1.282.000	Barclays Bank Plc	5,43 %	24.07.2023	1.282.000	0,08
1.542.832.955	Barclays Bank Plc	5,44 %	24.07.2023	1.542.832.955	91,87
Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt				1.544.114.955	91,95

Nominal- wert	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens
Swap-Kontrakte (30. Juni 2022: (6,90) %)			
1.732.556.255	Barclays Backwardation Tilt Multi-Strategy Capped Total Return Index ¹	21.07.2023 (53.399.628)	(3,18)
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten			(53.399.628) (3,18)

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Geldmarktinstrumente (30. Juni 2022: 9,58 %)			
118.468.861	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund	118.468.861	7,05
Geldmarktinstrumente insgesamt		118.468.861	7,05

Gesamtanlagen			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		1.544.114.955	91,95
Geldmarktinstrumente		118.468.861	7,05
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten		(53.399.628)	(3,18)

Anzahl der Kontrakte	Käufe	Verkäufe	Fälligkeits- termin	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens
Devisenterminkontrakte²					
1	100.000 GBP	(127.383) USD	06.07.2023	(247)	(0,00)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (30. Juni 2022: – %)				(247)	0,00
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				70.160.583	4,18
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen				1.679.344.524	100,00

L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

	% des Gesamt- vermö- gens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	6,83
Einlagen bei Kreditinstituten	89,00
Sonstige Vermögenswerte	4,17
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

² Der Kontrahent für die Devisenterminkontrakte ist die Bank of New York Mellon.

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %)			
Bermuda (30. Juni 2022: 1,26 %)			
43.414	China Gas Holdings Ltd	49.693	0,28
141.849	China Oriental Group Co Ltd	19.368	0,11
13.400	China Resources Gas Group Ltd	45.826	0,26
52.000	China Water Affairs Group Ltd	39.282	0,22
68.000	Kunlun Energy Co Ltd	53.452	0,30
68.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	41.911	0,23
33.565	PAX Global Technology Ltd	25.442	0,14
62.862	Shenzhen International Holdings Ltd	55.349	0,31
42.000	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	20.795	0,12
Bermuda insgesamt		351.118	1,97
Brasilien (30. Juni 2022: 4,68 %)			
24.700	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	74.807	0,42
8.974	Banco do Brasil SA	91.898	0,52
6.100	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP	71.533	0,40
11.900	Cia de Saneamento de Minas Gerais Copasa MG	52.173	0,29
13.100	Cia de Saneamento do Parana (Units)	59.363	0,33
18.000	Cia Siderurgica Nacional SA	45.261	0,25
9.600	CPFL Energia SA	68.438	0,38
16.365	Dexco SA	28.327	0,16
3.800	Direcional Engenharia SA	15.479	0,09
9.510	EDP - Energias do Brasil SA	46.564	0,26
7.200	Energisa S/A	74.925	0,42
6.000	Engie Brasil Energia SA	56.828	0,32
13.230	Fleury SA	44.018	0,25
9.457	Itau Unibanco Holding SA	48.069	0,27
17.970	Klabin SA	81.096	0,45

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Brasilien (30. Juni 2022: 4,68 %) (Fortsetzung)			
17.500	MRV Engenharia e Participacoes SA	41.972	0,24
16.335	Odontoprev SA	42.497	0,24
8.200	Porto Seguro SA	47.799	0,27
7.300	Sao Martinho S/A	51.678	0,29
5.830	SLC Agricola SA	46.190	0,26
8.600	Transmissora Alianca de Energia Eletrica S/A (Units)	67.103	0,38
3.565	Tupy SA	19.377	0,11
	Brasilien insgesamt	1.175.395	6,60
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 6,13 %)			
10.127	Apex International Co Ltd	20.550	0,12
5.127	Bizlink Holding Inc	53.008	0,30
124.000	Bosideng International Holdings Ltd	52.217	0,29
53.500	China Hongqiao Group Ltd	43.419	0,24
45.000	China Lesso Group Holdings Ltd	29.515	0,17
43.000	China Medical System Holdings Ltd	70.015	0,39
26.000	China Meidong Auto Holdings Ltd	30.026	0,17
82.048	China Resources Cement Holdings Ltd	33.818	0,19
54.000	China State Construction International Holdings Ltd	61.534	0,35
50.713	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	25.497	0,14
28.000	CIMC Enric Holdings Ltd	25.011	0,14
17.000	Consun Pharmaceutical Group Ltd	11.497	0,07
54.079	Dongyue Group Ltd	40.439	0,23
79.000	Fufeng Group Ltd	39.920	0,22
8.000	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	10.290	0,06
529	Horizon Construction Development Ltd	200	0,00
15.000	Kingboard Holdings Ltd	40.866	0,23
38.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	36.208	0,20
113.000	Lonking Holdings Ltd	18.601	0,11
12.584	NetDragon Websoft Holdings Ltd	23.670	0,13
76.000	SSY Group Ltd	48.490	0,27

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Cayman-Inseln (30. Juni 2022: 6,13 %) (Fortsetzung)			
25.000	TCL Electronics Holdings Ltd	12.984	0,07
25.500	Tian Lun Gas Holdings Ltd	17.897	0,10
30.000	Tianneng Power International Ltd	30.970	0,17
36.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	55.953	0,32
62.000	Uni-President China Holdings Ltd	52.217	0,29
25.000	Wisdom Marine Lines Co Ltd	39.172	0,22
44.500	Xtep International Holdings Ltd	45.314	0,26
12.343	Zhen Ding Technology Holding Ltd	41.613	0,23
Cayman-Inseln insgesamt		1.010.911	5,68
Chile (30. Juni 2022: 0,79 %)			
615.720	Banco de Chile	64.239	0,36
1.461	Banco de Credito e Inversiones SA	44.620	0,25
1.351.826	Banco Santander Chile	63.939	0,36
3.508	CAP SA	25.968	0,15
29.261	Cencosud SA	56.683	0,32
7.066	Cia Cervecerias Unidas SA	56.949	0,32
6.839	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA	27.498	0,15
7.168	Empresas Copec SA	53.169	0,30
Chile insgesamt		393.065	2,21
China (30. Juni 2022: 22,70 %)			
149.800	Agricultural Bank of China Ltd 'A'	72.689	0,41
168.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H'	66.029	0,37
10.900	Anhui Conch Cement Co Ltd 'A'	35.570	0,20
14.500	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	38.486	0,22
1.100	Anhui Expressway Co Ltd 'A'	1.585	0,01
26.000	Anhui Expressway Co Ltd 'H'	25.115	0,14
66.400	Bank of Beijing Co Ltd 'A'	42.260	0,24
141.100	Bank of China Ltd 'A'	75.837	0,43
126.000	Bank of China Ltd 'H'	50.486	0,28
76.700	Bank of Communications Co Ltd 'A'	61.151	0,34

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
China (30. Juni 2022: 22,70 %) (Fortsetzung)			
107.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	70.864	0,40
31.400	Bank of Nanjing Co Ltd 'A'	34.530	0,19
71.900	Baoshan Iron & Steel Co Ltd 'A'	55.545	0,31
22.200	BBMG Corp 'A'	6.653	0,04
119.000	BBMG Corp 'H'	13.059	0,07
74.000	Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H'	17.658	0,10
28.500	China CITIC Bank Corp Ltd 'A'	23.427	0,13
119.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	55.881	0,31
128.000	China Communications Services Corp Ltd 'H'	63.048	0,35
44.200	China Construction Bank Corp 'A'	38.034	0,21
84.000	China Construction Bank Corp 'H'	54.345	0,31
111.317	China Datang Corp Renewable Power Co Ltd 'H'	37.216	0,21
135.000	China Everbright Bank Co Ltd 'A'	56.971	0,32
192.101	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	55.155	0,31
30.323	China Life Insurance Co Ltd 'H'	50.535	0,28
11.700	China Merchants Bank 'A'	52.688	0,30
9.000	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	40.885	0,23
19.751	China Merchants Securities Co Ltd 'H' '144A'	18.600	0,10
127.200	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A'	65.569	0,37
136.500	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H'	50.513	0,28
52.000	China National Building Material Co Ltd 'H'	31.983	0,18
14.300	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'A'	51.069	0,29
17.400	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	44.962	0,25
107.000	China Railway Group Ltd 'H'	70.591	0,40
85.500	China State Construction Engineering Corp Ltd 'A'	67.462	0,38
89.533	China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H'	32.104	0,18
19.000	China Yangtze Power Co Ltd 'A'	57.615	0,32
4.300	Chinese Universe Publishing and Media Group Co Ltd 'A'	7.873	0,04
70.850	Chongqing Changan Automobile Co Ltd	33.090	0,19
9.100	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'A'	4.491	0,03
118.000	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'H'	41.709	0,23

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
China (30. Juni 2022: 22,70 %) (Fortsetzung)			
29.000	CITIC Securities Co Ltd 'H'	52.548	0,30
123.193	CRRC Corp Ltd 'H'	67.440	0,38
57.497	Daqin Railway Co Ltd 'A'	58.724	0,33
92.589	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	42.298	0,24
7.000	Fangda Special Steel Technology Co Ltd 'A'	4.455	0,02
3.300	Gansu Qilianshan Cement Group Co Ltd 'A'	5.158	0,03
32.200	GF Securities Co Ltd 'H'	44.459	0,25
41.659	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	47.684	0,27
88.754	Haitong Securities Co Ltd 'H'	54.363	0,31
10.900	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd 'A'	36.694	0,21
11.200	Hengyi Petrochemical Co Ltd 'A'	10.438	0,06
6.800	Huaibei Mining Holdings Co Ltd 'A'	10.768	0,06
46.400	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	57.315	0,32
51.800	Huaxia Bank Co Ltd 'A'	38.522	0,22
5.600	Huaxin Cement Co Ltd 'A'	9.507	0,05
11.200	Huayu Automotive Systems Co Ltd 'A'	28.420	0,16
100.700	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A'	66.720	0,37
117.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	62.407	0,35
20.300	Industrial Bank Co Ltd 'A'	43.671	0,25
4.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'A'	5.405	0,03
64.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	58.964	0,33
6.100	Joyoung Co Ltd 'A'	12.536	0,07
10.600	Keda Industrial Group Co Ltd	16.553	0,09
11.100	Lao Feng Xiang Co Ltd 'A'	40.859	0,23
7.200	Livzon Pharmaceutical Group Inc 'H'	24.761	0,14
11.300	Lomon Billions Group Co 'A'	25.630	0,14
68.000	PICC Property & Casualty Co Ltd 'H'	75.579	0,42
10.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	63.782	0,36
8.634	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	54.922	0,31
22.600	SAIC Motor Corp Ltd 'A'	44.021	0,25
23.500	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'H'	7.587	0,04

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
China (30. Juni 2022: 22,70 %) (Fortsetzung)			
35.700	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H'	70.702	0,40
55.300	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd 'A'	55.036	0,31
21.400	Shanxi Xishan Coal & Electricity Power Co Ltd 'A'	26.769	0,15
36.000	Shenzhen Expressway Corp Ltd 'H'	30.687	0,17
29.700	Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd 'A'	17.963	0,10
80.000	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	35.628	0,20
151.750	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H'	23.818	0,13
20.800	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	65.028	0,37
94.000	Sinotrans Ltd 'H'	33.466	0,19
29.000	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H'	28.791	0,16
6.000	Weifu High-Technology Group Co Ltd	7.189	0,04
3.000	Weifu High-Technology Group Co Ltd 'A'	6.495	0,04
9.300	Xiamen C & D Inc 'A'	13.947	0,08
66.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	50.111	0,28
15.600	Zhejiang Wanfeng Auto Wheel Co Ltd 'A'	14.861	0,08
20.100	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'A'	18.650	0,10
83.200	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	42.998	0,24
China insgesamt		3.487.662	19,58
Kolumbien (30. Juni 2022: 0,29 %)			
7.259	Bancolombia SA	53.889	0,30
11.484	Interconexion Electrica SA ESP	46.450	0,26
Kolumbien insgesamt		100.339	0,56
Tschechische Republik *30. Juni 2022: 0,11 %)			
25	Philip Morris CR AS	19.195	0,11
Tschechische Republik insgesamt		19.195	0,11
Ägypten (30. Juni 2022: 0,78 %)			
30.488	Commercial International Bank Egypt SAE	50.320	0,28
43.870	Eastern Co SAE	30.297	0,17
Ägypten insgesamt		80.617	0,45

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Griechenland (30. Juni 2022: 0,09 %)			
2.169	HELLENIQ ENERGY HOLDINGS S.A.	18.529	0,10
2.608	Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	66.012	0,37
Griechenland insgesamt		84.541	0,47
Hongkong (30. Juni 2022: 2,48 %)			
17.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	61.500	0,34
147.291	China Everbright Environment Group Ltd	58.077	0,33
66.400	China Zhongwang*	–	–
58.000	CITIC Ltd	69.201	0,39
11.000	CPMC Holdings Ltd	5.460	0,03
63.000	Far East Horizon Ltd	49.843	0,28
78.000	Fosun International Ltd	53.549	0,30
56.000	Guangdong Investment Ltd	48.307	0,27
27.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	39.140	0,22
98.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	24.636	0,14
Hongkong insgesamt		409.713	2,30
Ungarn (30. Juni 2022: 0,49 %)			
7.067	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	61.763	0,35
Ungarn insgesamt		61.763	0,35
Indien (30. Juni 2022: 5,43 %)			
1.270	Bajaj Auto Ltd	72.630	0,41
7.370	Bajaj Consumer Care Ltd	17.411	0,10
17.971	Bharat Petroleum Corp Ltd	79.892	0,45
1.233	Care Ratings Ltd	10.556	0,06
21.500	Castrol India Ltd	31.659	0,18
12.194	Engineers India Ltd	17.086	0,10
49.996	GAIL India Ltd	64.021	0,36
3.894	HCL Technologies Ltd	56.388	0,32
23.507	Hindustan Petroleum Corp Ltd	78.470	0,44
55.837	Indian Oil Corp Ltd	62.142	0,35
26.710	Indus Towers Ltd	53.478	0,30
11.882	ITC Ltd	65.409	0,37

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Indien (30. Juni 2022: 5,43 %) (Fortsetzung)			
47.433	National Aluminium Co Ltd	47.441	0,27
122.235	NHPC Ltd (Units)	68.466	0,38
32.829	NMDC Ltd	41.878	0,23
1.158	Oracle Financial Services Software Ltd	54.468	0,31
23.121	Petronet LNG Ltd	62.765	0,35
29.394	Power Finance Corp Ltd	77.358	0,43
22.976	Power Grid Corp of India Ltd	71.460	0,40
10.643	PTC India Ltd	14.946	0,08
34.208	REC Ltd	68.657	0,38
4.509	Sun TV Network Ltd	24.143	0,14
5.742	Welspun Corp Ltd	18.265	0,10
	Indien insgesamt	1.158.989	6,51
Indonesien (30. Juni 2022: 2,08 %)			
162.200	Bank Mandiri Persero Tbk PT	56.257	0,32
103.200	Bank Pembangunan Daerah Jawa Barat Dan Banten Tbk PT	8.123	0,05
174.900	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	63.287	0,35
21.500	Gudang Garam Tbk PT	39.616	0,22
79.000	Indocement Tungal Prakarsa Tbk PT	52.298	0,29
131.143	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	64.292	0,36
105.000	Matahari Department Store Tbk PT	23.672	0,13
201.000	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	53.627	0,30
174.800	Unilever Indonesia Tbk PT	49.668	0,28
22.700	United Tractors Tbk PT	35.240	0,20
	Indonesien insgesamt	446.080	2,50
Malaysia (30. Juni 2022: 2,83 %)			
55.100	Astro Malaysia Holdings Bhd	7.083	0,04
21.100	Bursa Malaysia Bhd	29.113	0,16
61.400	Hartalega Holdings Bhd	24.863	0,14
9.900	Hong Leong Bank Bhd	40.215	0,23
66.500	Kossan Rubber Industries Bhd	18.379	0,10
34.500	MISC Bhd	52.923	0,30
36.200	Petronas Chemicals Group Bhd	46.534	0,26

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Malaysia (30. Juni 2022: 2,83 %) (Fortsetzung)			
13.600	Petronas Dagangan Bhd	64.685	0,36
18.000	Petronas Gas Bhd	64.403	0,36
39.100	RHB Bank Bhd	45.487	0,26
13.100	Syarikat Takaful Malaysia Keluarga Bhd	9.318	0,05
23.500	Tenaga Nasional Bhd	45.565	0,26
	Malaysia insgesamt	448.568	2,52
Mexiko (30. Juni 2022: 2,67 %)			
96.900	Alfa SAB de CV	60.172	0,34
25.400	Alpek SAB de CV	25.222	0,14
6.300	Arca Continental SAB de CV	64.629	0,36
26.200	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	54.262	0,31
6.750	Coca-Cola Femsa SAB de CV (Units)	56.313	0,32
96.900	Controladora AXTEL SAB DE CV	1.254	0,01
2.800	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	50.159	0,28
5.700	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	46.931	0,26
26.700	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	59.268	0,33
15.600	Megacable Holdings SAB de CV	35.911	0,20
30.500	Orbia Advance Corp SAB de CV	65.586	0,37
	Mexiko insgesamt	519.707	2,92
Pakistan (30. Juni 2022: 0,43 %)			
23.401	MCB Bank Ltd	9.348	0,05
6.142	Pakistan Oilfields Ltd	8.612	0,05
13.794	United Bank Ltd/Pakistan	5.658	0,03
	Pakistan insgesamt	23.618	0,13
Philippinen (30. Juni 2022: 0,58 %)			
1.625	Globe Telecom Inc	50.958	0,29
15.390	International Container Terminal Services Inc	56.821	0,32
124.429	LT Group Inc	21.437	0,12
	Philippinen insgesamt	129.216	0,73

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Katar (30. Juni 2022: 1,18 %)			
7.059	Al Meera Consumer Goods Co QSC	27.189	0,15
79.927	Masraf Al Rayan QSC	56.278	0,32
11.878	Qatar Electricity & Water Co QSC	56.780	0,32
12.398	Qatar International Islamic Bank QSC	34.060	0,19
	Katar insgesamt	174.307	0,98
Rumänien (30. Juni 2022: – %)			
388.373	OMV Petrom SA	42.720	0,24
	Rumänien insgesamt	42.720	0,24
Russland (30. Juni 2022: – %)			
34.780	Alrosa PJSC*	–	–
15.480	Gazprom PJSC*	–	–
742	LUKOIL PJSC*	–	–
2.350	M.Video PJSC*	–	–
871	Magnit PJSC*	–	–
15.870	Mobile TeleSystems PJSC*	–	–
458.000	Mosenergo PJSC*	–	–
19.790	Novolipetsk Steel PJSC*	–	–
42.790	Rostelecom PJSC*	–	–
5.039.000	RusHydro PJSC*	–	–
15.290	Sberbank of Russia PJSC*	–	–
2.834	Severstal PAO*	–	–
128.500	Sistema PJSFC*	–	–
13.280	Tatneft PJSC*	–	–
387.000	Unipro PJSC*	–	–
95.730.000	VTB Bank PJSC*	–	–
	Russland insgesamt	–	–
Saudi-Arabien (30. Juni 2022: 2,28 %)			
6.597	Banque Saudi Fransi	73.345	0,41
13.510	Jarir Marketing Co	59.577	0,33
6.670	Riyad Bank	59.841	0,33

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Saudi-Arabien (30. Juni 2022: 2,28 %) (Fortsetzung)			
5.937	Saudi Telecom Co	68.857	0,39
1.792	United International Transportation Co	35.069	0,20
6.013	Yanbu National Petrochemical Co	76.070	0,43
Saudi-Arabien insgesamt		372.759	2,09
Südafrika (30. Juni 2022: 3,12 %)			
5.021	African Rainbow Minerals Ltd	52.894	0,30
1.315	Astral Foods Ltd	10.667	0,06
15.636	AVI Ltd	56.357	0,31
3.328	Clicks Group Ltd	46.031	0,26
2.107	Kumba Iron Ore Ltd	49.358	0,28
9.371	Omnia Holdings Ltd	29.832	0,17
16.388	Pick n Pay Stores Ltd	33.728	0,19
15.839	Sanlam Ltd	48.922	0,27
6.087	SPAR Group Ltd/The	33.832	0,19
8.120	Vodacom Group Ltd	50.376	0,28
Südafrika insgesamt		411.997	2,31
Taiwan (30. Juni 2022: 24,98 %)			
7.000	Accton Technology Corp	78.441	0,44
6.000	Advantech Co Ltd	78.890	0,44
52.000	Asia Cement Corp	74.132	0,42
12.764	Asia Vital Components Co Ltd	111.064	0,62
7.851	Asustek Computer Inc	79.280	0,45
4.000	AURAS Technology Co Ltd	38.145	0,21
7.000	Catcher Technology Co Ltd	39.445	0,22
32.448	Cathay Financial Holding Co Ltd	44.956	0,25
23.000	Chicony Electronics Co Ltd	72.372	0,41
24.700	China General Plastics Corp	18.558	0,10
69.909	China Steel Corp	65.993	0,37
28.000	Chibond Technology Corp	56.729	0,32
8.000	Chroma ATE Inc	64.345	0,36
18.799	Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp	82.694	0,46
5.266	Cleanaway Co Ltd	35.846	0,20

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Taiwan (30. Juni 2022: 24,98 %) (Fortsetzung)			
53.000	Compal Electronics Inc	49.776	0,28
38.000	Compeq Manufacturing Co Ltd	54.173	0,30
73.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	58.246	0,33
3.300	Cub Elecparts Inc	17.271	0,10
9.000	Darfon Electronics Corp	13.380	0,07
5.000	Delta Electronics Inc	55.307	0,31
8.000	E Ink Holdings Inc	57.795	0,32
12.000	Elan Microelectronics Corp	39.108	0,22
11.000	Elite Material Co Ltd	86.002	0,48
42.000	Far Eastern New Century Corp	45.109	0,25
9.000	Feng TAY Enterprise Co Ltd	56.784	0,32
82.620	First Financial Holding Co Ltd	73.350	0,41
15.000	FLEXium Interconnect Inc	44.599	0,25
20.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	43.090	0,24
17.000	Formosa Plastics Corp	46.779	0,26
26.686	Foxconn Technology Co Ltd	47.641	0,27
26.040	Fubon Financial Holding Co Ltd	50.835	0,29
16.000	Getac Holdings Corp	34.369	0,19
13.000	Gigabyte Technology Co Ltd	101.639	0,57
5.000	Grape King Bio Ltd	26.971	0,15
13.762	Greatek Electronics Inc	25.275	0,14
9.000	Holtek Semiconductor Inc	19.737	0,11
21.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	76.193	0,43
8.515	Hsin Kuang Steel Co Ltd	12.659	0,07
4.000	Hu Lane Associate Inc	21.384	0,12
3.000	Innodisk Corp	31.209	0,18
14.321	ITEQ Corp	31.774	0,18
39.000	King Yuan Electronics Co Ltd	71.377	0,40
54.833	King's Town Bank Co Ltd	62.589	0,35
21.000	Lite-On Technology Corp	69.788	0,39
8.000	Makalot Industrial Co Ltd	77.574	0,44
2.474	MediaTek Inc	54.652	0,31
54.325	Mega Financial Holding Co Ltd	66.632	0,37
12.787	Merry Electronics Co Ltd	39.045	0,22

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Taiwan (30. Juni 2022: 24,98 %) (Fortsetzung)			
12.000	Micro-Star International Co Ltd	68.006	0,38
35.000	Mitac Holdings Corp	39.277	0,22
2.000	Nan Liu Enterprise Co Ltd	5.157	0,03
19.000	Nan Ya Plastics Corp	44.229	0,25
4.000	Novatek Microelectronics Corp	54.777	0,31
8.000	Nuvoton Technology Corp	33.007	0,19
26.519	Pegatron Corp	63.691	0,36
4.000	Phison Electronics Corp	52.850	0,30
7.000	Pixart Imaging Inc	24.611	0,14
22.000	Powertech Technology Inc	74.170	0,42
2.130	Poya International Co Ltd	40.487	0,23
15.000	Primax Electronics Ltd	31.691	0,18
18.619	Quanta Computer Inc	90.870	0,51
18.000	Radiant Opto-Electronics Corp	63.575	0,36
3.000	Raydium Semiconductor Corp	30.920	0,17
4.000	Realtek Semiconductor Corp	49.768	0,28
7.000	Shin Zu Shing Co Ltd	20.318	0,11
21.159	Sigurd Microelectronics Corp	37.570	0,21
6.000	Simplo Technology Co Ltd	63.286	0,36
7.000	Sinbon Electronics Co Ltd	83.048	0,47
80.698	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	44.955	0,25
8.000	Sunonwealth Electric Machine Industry Co Ltd	23.889	0,13
27.289	Supreme Electronics Co Ltd	42.408	0,24
35.618	TA Chen Stainless Pipe	54.208	0,30
79.000	Taishin Financial Holding Co Ltd	47.941	0,27
40.697	Taiwan Cement Corp	49.721	0,28
26.000	Taiwan Fertilizer Co Ltd	50.507	0,28
11.581	Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd	39.230	0,22
11.000	Taiwan Paiho Ltd	19.214	0,11
10.104	Taiwan Secom Co Ltd	37.146	0,21
13.000	Taiwan Surface Mounting Technology Corp	41.950	0,24
11.000	Taiwan Union Technology Corp	26.666	0,15
52.000	Teco Electric and Machinery Co Ltd	88.992	0,50
27.000	Tong Yang Industry Co Ltd	45.687	0,26

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Taiwan (30. Juni 2022: 24,98 %) (Fortsetzung)			
7.000	Topco Scientific Co Ltd	41.019	0,23
16.000	Tripod Technology Corp	63.446	0,36
12.000	TTY Biopharm Co Ltd	30.208	0,17
13.000	TXC Corp	39.153	0,22
13.000	Unimicron Technology Corp	73.464	0,41
28.000	Uni-President Enterprises Corp	68.596	0,39
38.073	United Microelectronics Corp	59.289	0,33
17.000	Vanguard International Semiconductor Corp	48.034	0,27
18.000	WT Microelectronics Co Ltd	39.301	0,22
67.980	Yuanta Financial Holding Co Ltd	50.421	0,28
Taiwan insgesamt		4.699.755	26,39
Thailand (30. Juni 2022: 4,18 %)			
20.000	Delta Electronics Thailand PCL	51.897	0,29
11.600	Electricity Generating PCL	42.696	0,24
39.900	Hana Microelectronics PCL	53.174	0,30
34.200	Kiatnakin Phatra Bank PCL	57.635	0,32
7.959	Major Cineplex Group PCL	3.277	0,02
54.600	PTT PCL	51.589	0,29
42.792	Ratch Group PCL	43.148	0,24
59.200	Ratchthani Leasing PCL	5.377	0,03
6.800	Siam Cement PCL/The	61.757	0,35
110.400	Thai Union Group PCL	40.168	0,22
30.330	Thai Vegetable Oil PCL	21.600	0,12
43.100	Thanachart Capital PCL	60.477	0,34
27.300	Tipco Asphalt PCL	14.399	0,08
15.500	Tisco Financial Group PCL	42.406	0,24
1.537.000	TMBThanachart Bank PCL	67.194	0,38
397.900	TPI Polene PCL	16.497	0,09
55.200	TTW PCL	13.467	0,08
Thailand insgesamt		646.758	3,63
Türkei (30. Juni 2022: 2,88 %)			
5.510	Arcelik AS	27.476	0,15

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (30. Juni 2022: 95,15 %) (Fortsetzung)			
Türkei (30. Juni 2022: 2,88 %) (Fortsetzung)			
8.000	BIM Birlesik Magazalar AS	52.321	0,29
3.361	Coca-Cola Icecek AS	33.894	0,19
31.890	Enka Insaat ve Sanayi AS	35.841	0,20
24.208	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	34.097	0,19
1.974	Ford Otomotiv Sanayi AS	57.622	0,32
22.769	Haci Omer Sabanci Holding AS	40.193	0,23
1.220	Otokar Otomotiv Ve Savunma Sanayi A.S.	9.177	0,05
6.798	Tekfen Holding AS	10.039	0,06
5.995	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	58.064	0,33
28.647	Turk Telekomunikasyon AS	22.790	0,13
724	Turk Traktor ve Ziraat Makineleri AS	11.277	0,06
33.927	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	47.240	0,27
	Türkei insgesamt	440.031	2,47
Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2022: 2,13 %)			
26.855	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	59.296	0,33
16.004	Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	46.360	0,26
101.843	Dubai Investments PJSC	64.605	0,36
36.676	Dubai Islamic Bank PJSC	54.619	0,31
7.664	Emirates Telecommunications Group Co PJSC	46.739	0,26
11.921	First Abu Dhabi Bank PJSC	44.269	0,25
63.943	Sharjah Islamic Bank	36.210	0,21
	Vereinigte Arabische Emirate insgesamt	352.098	1,98
	Stammaktien insgesamt	17.040.922	95,68
Vorzugsaktien (30. Juni 2022: 3,39 %)			
Brasilien (30. Juni 2022: 2,40 %)			
8.700	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA - Preference	27.052	0,15
11.142	Bradespar SA - Preference	51.298	0,29
48.300	Cia Paranaense de Energia - Preference	83.003	0,47
8.200	CTEEP-Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista - Preference	43.108	0,24
10.654	Gerdau SA - Preference	55.368	0,31
12.911	Itau Unibanco Holding SA - Preference	76.064	0,43
	Brasilien insgesamt	335.893	1,89

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Vorzugsaktien (30. Juni 2022: 3,39 %) (Fortsetzung)			
Chile (30. Juni 2022: 0,71 %)			
25.378	Embotelladora Andina SA - Preference	66.470	0,37
639	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA - Preference - Class B	46.521	0,26
Chile insgesamt		112.991	0,63
Kolumbien (30. Juni 2022: 0,28 %)			
5.520	Banco Davivienda SA - Preference	25.923	0,14
9.295	Bancolombia SA - Preference	62.304	0,35
242.990	Grupo Aval Acciones y Valores SA - Preference	28.280	0,16
Kolumbien insgesamt		116.507	0,65
Russland (30. Juni 2022: – %)			
160.100	Surgutneftegas PJSC - Preference*	–	–
7.493	Tatneft PJSC - Preference*	–	–
41	Transneft PJSC - Preference*	–	–
Russland insgesamt		–	–
Vorzugsaktien Insgesamt		565.391	3,17
Bezugsrechte (30. Juni 2022: – %)			
Taiwan (30. Juni 2022: – %)			
202	Topco Scientific Co Ltd Rights 27/07/2023	–	–
Taiwan insgesamt		–	–
Bezugsrechte insgesamt		–	–
Gesamtanlagen			
Stammaktien		17.040.922	95,68
Vorzugsaktien		565.391	3,17
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		203.635	1,15
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		17.809.948	100,00

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		98,36
Sonstige Vermögenswerte		1,64
		100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

*Diese Wertpapiere werden mit Null bewertet

L&G India INR Government Bond UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Staatsanleihe (30. Juni 2022: 99,09 %)					
Indien (30. Juni 2022: 99,09 %)					
830.300.000	India Government Bond	6,18 %	04.11.2024	10.015.819	2,59
1.270.600.000	India Government Bond	5,22 %	15.06.2025	14.979.716	3,87
1.266.800.000	India Government Bond	5,15 %	09.11.2025	14.844.105	3,84
1.612.200.000	India Government Bond	5,63 %	12.04.2026	18.947.063	4,90
874.000.000	India Government Bond	5,74 %	15.11.2026	10.231.401	2,64
1.499.000.000	India Government Bond	7,38 %	20.06.2027	18.462.349	4,77
30.000.000	India Government Bond	7,10 %	27.01.2028	366.017	0,09
1.469.700.000	India Government Bond	7,26 %	14.01.2029	18.047.898	4,66
1.671.600.000	India Government Bond	7,10 %	18.04.2029	20.376.763	5,26
1.219.000.000	India Government Bond	6,45 %	07.10.2029	14.376.579	3,71
279.000.000	India Government Bond	7,17 %	17.04.2030	3.409.574	0,88
1.212.700.000	India Government Bond	5,79 %	11.05.2030	13.751.779	3,55
1.309.600.000	India Government Bond	5,77 %	03.08.2030	14.804.866	3,83
1.301.100.000	India Government Bond	5,85 %	01.12.2030	14.735.869	3,81
1.558.800.000	India Government Bond	6,10 %	12.07.2031	17.875.586	4,62
1.859.000.000	India Government Bond	6,54 %	17.01.2032	21.791.786	5,63
1.448.000.000	India Government Bond	7,26 %	22.08.2032	17.762.549	4,59
30.000.000	India Government Bond	7,29 %	27.01.2033	371.191	0,10
275.000.000	India Government Bond	7,26 %	06.02.2033	3.387.944	0,87
819.000.000	India Government Bond	7,26 %	06.02.2033	10.089.913	2,61
1.760.000.000	India Government Bond	7,54 %	23.05.2036	22.004.006	5,69
1.195.000.000	India Government Bond	7,41 %	19.12.2036	14.808.828	3,83
908.500.000	India Government Bond	7,72 %	15.06.2049	11.634.900	3,01
1.053.400.000	India Government Bond	7,16 %	20.09.2050	12.649.753	3,27
1.706.000.000	India Government Bond	6,67 %	17.12.2050	19.223.737	4,97
1.762.000.000	India Government Bond	6,99 %	15.12.2051	20.646.424	5,33
1.429.000.000	India Government Bond	7,36 %	12.09.2052	17.429.926	4,50
332.000.000	India Government Bond	7,06 %	10.04.2028	4.040.597	1,04
Indien insgesamt				381.066.938	98,46
Staatsanleihe insgesamt				381.066.938	98,46

L&G India INR Government Bond UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Staatsanleihe	381.066.938	98,46
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten*	5.941.118	1,54
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	387.008.056	100,00

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	96,58
Sonstige Vermögenswerte	3,42
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

*In den sonstigen Vermögenswerten sind Anteile am LGIM Dollar Liquidity Fund mit einem Wert von 114.861 US\$ enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien			
Österreich			
9.989	ams-OSRAM AG	71.927	1,94
Österreich insgesamt		71.927	1,94
Kanada			
634	Novanta Inc	116.719	3,15
Kanada insgesamt		116.719	3,15
Cayman-Inseln			
798	Fabrinet	103.644	2,80
7.422	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	74.016	2,00
Cayman-Inseln insgesamt		177.660	4,80
Deutschland			
3.532	AIXTRON SE	119.803	3,24
689	Carl Zeiss Meditec AG	74.449	2,01
3.236	Jenoptik AG	110.999	3,00
Deutschland insgesamt		305.251	8,25
Israel			
7.172	Stratasys Ltd	127.375	3,44
Israel insgesamt		127.375	3,44
Italien			
6.311	El.En. SpA	75.670	2,04
Italien insgesamt		75.670	2,04
Japan			
2.005	Hamamatsu Photonics KK	97.465	2,63
2.264	Horiba Ltd	128.930	3,48
937	Hoya Corp	110.695	2,99

L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
225	Keyence Corp	105.623	2,86
617	Lasertec Corp (Units)	92.101	2,49
11.118	Nikon Corp	142.884	3,86
5.622	Olympus Corp	88.141	2,38
8.575	Topcon Corp	125.064	3,38
8.161	Ushio Inc	109.427	2,96
Japan insgesamt		1.000.330	27,03
Niederlande			
152	ASML Holding NV	109.948	2,97
2.815	Signify NV '144A'	78.837	2,13
Niederlande insgesamt		188.785	5,10
Schweden			
8.915	Hexagon AB	109.566	2,96
Schweden insgesamt		109.566	2,96
Schweiz			
140	Bystronic AG	93.110	2,52
Schweiz insgesamt		93.110	2,52
Vereinigtes Königreich			
2.172	Renishaw Plc	107.749	2,91
Vereinigtes Königreich insgesamt		107.749	2,91
Vereinigte Staaten			
1.898	Cognex Corp	106.326	2,87
2.970	Corning Inc	104.069	2,81
49.833	Desktop Metal Inc	88.204	2,38
3.659	FARO Technologies Inc	59.276	1,60

L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
3.512	Gentex Corp	102.761	2,78
921	IPG Photonics Corp	125.090	3,38
14.845	Lightwave Logic Inc	103.470	2,80
1.714	Lumentum Holdings Inc	97.235	2,63
13.857	Luminar Technologies Inc - Class A	95.336	2,58
11.292	Luna Innovations Inc	102.983	2,78
971	MKS Instruments Inc	104.965	2,84
8.171	nLight Inc	125.997	3,40
18.460	Vuzix Corp	94.146	2,54
	Vereinigte Staaten insgesamt	1.309.858	35,39
	Stammaktien insgesamt	3.684.000	99,53
Gesamtanlagen			
	Stammaktien	3.684.000	99,53
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	17.493	0,47
	Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	3.701.493	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			% des Gesamtvermögens
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		81,70
	Sonstige Vermögenswerte		18,30
			100,00
	Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien			
Australien			
2.187	Allkem Ltd	23.322	0,62
1.506	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	17.925	0,47
442	Mineral Resources Ltd	21.016	0,55
6.506	Pilbara Minerals Ltd	21.178	0,56
Australien insgesamt		83.441	2,20
Österreich			
214	ANDRITZ AG	11.919	0,31
Österreich insgesamt		11.919	0,31
Belgien			
588	bpost SA	2.581	0,07
Belgien insgesamt		2.581	0,07
Bermuda			
2.128	AutoStore Holdings Ltd '144A'	4.658	0,12
18.825	Beijing Enterprises Water Group Ltd	4.468	0,12
5.290	China Water Affairs Group Ltd	3.996	0,11
2.000	Kerry Logistics Network Ltd	2.361	0,06
Bermuda insgesamt		15.483	0,41
Brasilien			
830	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP ADR	9.827	0,26
Brasilien insgesamt		9.827	0,26
Britische Jungferninseln			
3.004	Emeren Group Ltd ADR	11.385	0,30
Britische Jungferninseln insgesamt		11.385	0,30
Kanada			
104	ATS Corp	4.791	0,13
495	Boralex Inc	13.493	0,35
326	Canadian Solar Inc	12.613	0,33
127	Descartes Systems Group Inc/The	10.185	0,27
69	Novanta Inc	12.703	0,33

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Kanada (Fortsetzung)			
635	Primo Water Corp	7.966	0,21
416	Shopify Inc - Class A	26.917	0,71
Kanada insgesamt		88.668	2,33
Cayman-Inseln			
146	Airtac International Group	4.805	0,13
165	Alibaba Group Holding Ltd ADR	13.753	0,36
92	Ambarella Inc	7.698	0,20
86	BeiGene Ltd ADR	15.334	0,40
5.480	China Lesso Group Holdings Ltd	3.594	0,09
4.000	Innovent Biologics Inc '144A'	15.109	0,40
600	JD Health International Inc '144A'	3.786	0,10
4.261	JD Logistics Inc '144A'	6.644	0,17
68	JD.com Inc ADR	2.321	0,06
1.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	1.337	0,04
1.058	Vipshop Holdings Ltd ADR	17.457	0,46
487	Zai Lab Ltd ADR	13.504	0,36
Cayman-Inseln insgesamt		105.342	2,77
China			
1.128	BYD Co Ltd 'H'	35.985	0,95
13.000	Sinotrans Ltd 'H'	4.628	0,12
China insgesamt		40.613	1,07
Dänemark			
5	AP Moller - Maersk A/S - Class B	8.773	0,23
78	DSV A/S	16.377	0,43
56	Genmab A/S	21.170	0,56
154	Orsted AS '144A'	14.550	0,38
460	Vestas Wind Systems A/S	12.230	0,32
Dänemark insgesamt		73.100	1,92

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Finnland			
767	Metso Oyj	9.242	0,24
146	Uponor Oyj	4.562	0,12
404	Valmet Oyj	11.231	0,30
Finnland insgesamt		25.035	0,66
Frankreich			
195	Dassault Systemes SE	8.643	0,23
169	Ipsen SA	20.319	0,53
568	Neoen SA '144A'	17.971	0,47
139	Nexans SA	12.033	0,32
678	Renault SA	28.538	0,75
101	Schneider Electric SE	18.342	0,48
Frankreich insgesamt		105.846	2,78
Deutschland			
259	Bayerische Motoren Werke AG	31.795	0,84
295	DHL Group	14.396	0,38
97	Duerr AG	3.137	0,08
122	GEA Group AG	5.099	0,13
407	Infineon Technologies AG	16.778	0,44
134	Jenoptik AG	4.596	0,12
100	KION Group AG	4.022	0,11
42	Krones AG	5.091	0,13
352	Mercedes-Benz Group AG	28.292	0,75
907	Nordex SE	11.009	0,29
68	Norma Group SE	1.255	0,03
101	SAP SE	13.789	0,36
15	Siemens AG	2.496	0,07
619	Siemens Energy AG	10.927	0,29
126	Siemens Healthineers AG '144A'	7.129	0,19
184	SMA Solar Technology AG	22.463	0,59
450	Zalando SE '144A'	12.942	0,34
Deutschland insgesamt		195.216	5,14

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Irland			
10	Accenture Plc - Class A	3.086	0,08
185	Horizon Therapeutics Plc	19.027	0,50
138	Jazz Pharmaceuticals Plc	17.108	0,45
133	Pentair Plc	8.592	0,23
Irland insgesamt		47.813	1,26
Israel			
92	Check Point Software Technologies Ltd	11.557	0,30
86	CyberArk Software Ltd	13.444	0,35
172	JFrog Ltd	4.765	0,13
16	Nice Ltd ADR	3.304	0,09
544	Radware Ltd	10.548	0,28
397	Stratasys Ltd	7.051	0,19
21	Wix.com Ltd	1.643	0,04
Israel insgesamt		52.312	1,38
Italien			
70	DiaSorin SpA	7.286	0,19
Italien insgesamt		7.286	0,19
Japan			
866	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	24.482	0,64
198	Daifuku Co Ltd	4.031	0,11
79	Daihen Corp	3.028	0,08
395	Eisai Co Ltd	26.575	0,70
130	FANUC Corp	4.526	0,12
265	Fuji Corp/Aichi	4.660	0,12
394	GS Yuasa Corp	7.657	0,20
222	Harmonic Drive Systems Inc	7.081	0,19
1.989	Hitachi Zosen Corp	13.059	0,34
1.307	Japan Post Holdings Co Ltd	9.373	0,25
1.876	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	16.471	0,43
11	Keyence Corp	5.164	0,14
483	Kitz Corp	3.626	0,09

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
159	Kurita Water Industries Ltd	6.044	0,16
981	Kyowa Kirin Co Ltd	18.081	0,47
1.041	Marubeni Corp	17.574	0,46
205	METAWATER Co Ltd	2.601	0,07
303	Mitsubishi Electric Corp	4.249	0,11
133	Nabtesco Corp	2.907	0,08
1.539	NGK Insulators Ltd	18.251	0,48
141	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	7.906	0,21
473	Nippon Shinyaku Co Ltd	19.223	0,51
6.375	Nissan Motor Co Ltd	25.944	0,68
68	Omron Corp	4.125	0,11
100	Optex Group Co Ltd	1.398	0,04
319	Organo Corp	9.347	0,25
2.411	Panasonic Holdings Corp	29.250	0,77
1.889	Rakuten Group Inc	6.522	0,17
1.173	Renesas Electronics Corp	21.924	0,58
968	Senko Group Holdings Co Ltd	6.932	0,18
110	Shibaura Machine Co Ltd	3.687	0,10
7	SMC Corp	3.849	0,10
3.048	Sumitomo Electric Industries Ltd	37.052	0,97
633	TDK Corp	24.381	0,64
193	Terumo Corp	6.092	0,16
150	THK Co Ltd	3.056	0,08
579	Toshiba Corp	18.095	0,48
61	Toyota Industries Corp	4.328	0,11
215	Trend Micro Inc/Japan	10.331	0,27
571	West Holdings Corp	9.853	0,26
107	Yaskawa Electric Corp	4.873	0,13
202	Yokogawa Electric Corp	3.704	0,10
	Japan insgesamt	461.312	12,14
Jersey			
25	Aptiv Plc	2.552	0,07
57	Ferguson Plc	8.967	0,24
95	Novocure Ltd	3.942	0,10
	Jersey insgesamt	15.461	0,41

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Luxemburg			
104	Eurofins Scientific SE	6.599	0,17
21	Spotify Technology SA	3.372	0,09
Luxemburg insgesamt		9.971	0,26
Mauritius			
2.116	Azure Power Global Ltd	3.745	0,10
Mauritius insgesamt		3.745	0,10
Niederlande			
173	Aalberts NV	7.272	0,19
168	Alfen N.V. '144A'	11.287	0,30
269	AMG Critical Materials NV	13.937	0,37
6	ASML Holding NV NY Reg Shrs	4.349	0,11
417	Koninklijke Philips NV	9.012	0,24
66	NXP Semiconductors NV	13.509	0,35
239	QIAGEN NV	10.762	0,28
244	STMicroelectronics NV	12.130	0,32
Niederlande insgesamt		82.258	2,16
Neuseeland			
223	Mainfreight Ltd	9.837	0,26
Neuseeland insgesamt		9.837	0,26
Norwegen			
1.807	Scatec ASA '144A'	11.857	0,31
Norwegen insgesamt		11.857	0,31
Südkorea			
157	CJ Logistics Corp	9.103	0,24
471	HD Hyundai Electric Co Ltd	23.270	0,61
262	Koh Young Technology Inc	3.062	0,08
51	LG Energy Solution Ltd	21.404	0,57
41	Samsung SDI Co Ltd	20.817	0,55
85	Sebang Global Battery Co Ltd	3.113	0,08
Südkorea insgesamt		80.769	2,13

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Spanien			
70	Acciona SA	11.868	0,31
620	EDP Renovaveis SA	12.375	0,33
275	Greenergy Renovables SA	8.461	0,22
740	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	11.339	0,30
1.144	Soltec Power Holdings SA	5.250	0,14
Spanien insgesamt		49.293	1,30
Schweden			
338	Elektro AB	2.608	0,07
360	Hexagon AB	4.424	0,12
906	Swedish Orphan Biovitrum AB	17.648	0,46
Schweden insgesamt		24.680	0,65
Schweiz			
82	CRISPR Therapeutics AG	4.603	0,12
16	Geberit AG	8.372	0,22
25	Kardex Holding AG	5.603	0,15
48	Kuehne + Nagel International AG	14.202	0,37
9	Lonza Group AG	5.366	0,14
16	Roche Holding AG	4.891	0,13
27	Tecan Group AG	10.358	0,27
Schweiz insgesamt		53.395	1,40
Taiwan			
89	Advantech Co Ltd	1.170	0,03
3.506	Delta Electronics Inc	38.781	1,02
1.768	Dimerco Express Corp	5.240	0,14
3.000	Elan Microelectronics Corp	9.777	0,26
169	eMemory Technology Inc	11.992	0,31
142	Global Unichip Corp	7.318	0,19
543	Hiwin Technologies Corp	4.141	0,11
49	MediaTek Inc	1.082	0,03
67	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.239	0,03
Taiwan insgesamt		80.740	2,12

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich			
298	AstraZeneca Plc ADR	21.328	0,56
5.128	Darktrace Plc	20.093	0,53
2.691	GB Group Plc	7.834	0,20
916	Genuit Group Plc	3.418	0,09
2.462	Ocado Group Plc	17.779	0,47
914	Pennon Group Plc	8.262	0,22
78	Renishaw Plc	3.869	0,10
254	Severn Trent Plc	8.286	0,22
314	Smith & Nephew Plc	5.062	0,13
713	United Utilities Group Plc	8.717	0,23
	Vereinigtes Königreich insgesamt	104.648	2,75
Vereinigte Staaten			
640	3D Systems Corp	6.355	0,17
126	A O Smith Corp	9.170	0,24
780	A10 Networks Inc	11.380	0,30
69	Abbott Laboratories	7.522	0,20
8	Adobe Inc	3.912	0,10
96	Advanced Drainage Systems Inc	10.923	0,29
46	Advanced Micro Devices Inc	5.240	0,14
51	Agilent Technologies Inc	6.133	0,16
18	Align Technology Inc	6.366	0,17
136	Alnylam Pharmaceuticals Inc	25.832	0,68
35	Alphabet Inc - Class A	4.190	0,11
53	Alteryx Inc - Class A	2.406	0,06
125	Amazon.com Inc	16.295	0,43
310	Ameresco Inc - Class A	15.075	0,40
103	American States Water Co	8.961	0,24
55	American Water Works Co Inc	7.851	0,21
119	Arista Networks Inc	19.285	0,51
689	Array Technologies Inc	15.571	0,41
220	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	7.845	0,21
69	Artesian Resources Corp - Class A	3.258	0,09
20	Atlassian Corp	3.356	0,09

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
38	Autodesk Inc	7.775	0,20
137	Avanos Medical Inc	3.502	0,09
385	Axogen Inc	3.515	0,09
290	Azenta Inc	13.537	0,36
1.684	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	9.936	0,26
63	Badger Meter Inc	9.296	0,24
94	Baxter International Inc	4.283	0,11
24	Becton Dickinson & Co	6.336	0,17
196	Bentley Systems Inc - Class B	10.629	0,28
2.292	BioCryst Pharmaceuticals Inc	16.136	0,42
75	Biogen Inc	21.364	0,56
252	BioMarin Pharmaceutical Inc	21.843	0,57
10	Bio-Rad Laboratories Inc	3.791	0,10
54	Block Inc	3.595	0,09
3.824	Bluebird Bio Inc	12.581	0,33
1	Booking Holdings Inc	2.700	0,07
133	Boston Scientific Corp	7.194	0,19
50	Bristol-Myers Squibb Co	3.198	0,08
20	Broadcom Inc	17.349	0,46
3.364	Butterfly Network Inc	7.737	0,20
128	C3.ai Inc	4.663	0,12
19	Cadence Design Systems Inc	4.456	0,12
138	California Water Service Group	7.125	0,19
924	CareDx Inc	7.854	0,21
99	Catalent Inc	4.293	0,11
1.221	Cerus Corp	3.004	0,08
28	Charles River Laboratories International Inc	5.887	0,15
269	Cloudflare Inc	17.585	0,46
1.138	Codexis Inc	3.186	0,08
177	Cognex Corp	9.916	0,26
89	Concentrix Corp	7.187	0,19
45	CONMED Corp	6.115	0,16
343	Core & Main Inc - Class A	10.750	0,28
45	CoStar Group Inc	4.005	0,11

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
130	CrowdStrike Holdings Inc	19.093	0,50
33	Danaher Corp	7.920	0,21
8	Deere & Co	3.242	0,09
277	Dell Technologies Inc	14.988	0,39
69	Dexcom Inc	8.867	0,23
258	Dynatrace Inc	13.279	0,35
242	eBay Inc	10.815	0,28
51	Ecolab Inc	9.521	0,25
348	Editas Medicine Inc	2.864	0,08
79	Edwards Lifesciences Corp	7.452	0,20
26	Electronic Arts Inc	3.372	0,09
1.842	Emergent BioSolutions Inc	13.539	0,36
351	Energy Recovery Inc	9.810	0,26
323	EnerSys	35.052	0,92
65	Enphase Energy Inc	10.886	0,29
1.497	ESS Tech Inc	2.201	0,06
30	Etsy Inc	2.538	0,07
83	Exact Sciences Corp	7.794	0,21
102	Expeditors International of Washington Inc	12.355	0,33
78	F5 Inc	11.408	0,30
7	Fair Isaac Corp	5.664	0,15
51	FARO Technologies Inc	826	0,02
1.144	Fastly Inc	18.041	0,47
989	Fate Therapeutics Inc	4.708	0,12
58	FedEx Corp	14.378	0,38
67	First Solar Inc	12.736	0,34
27	Fiserv Inc	3.406	0,09
229	Fortinet Inc	17.310	0,46
87	Franklin Electric Co Inc	8.952	0,24
205	Fulgent Genetics Inc	7.591	0,20
137	Gen Digital Inc	2.541	0,07
113	Globus Medical Inc	6.728	0,18
134	Gorman-Rupp Co/The	3.863	0,10
242	Guardant Health Inc	8.664	0,23

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
321	GXO Logistics Inc	20.165	0,53
433	Halozyme Therapeutics Inc	15.618	0,41
438	Health Catalyst Inc	5.475	0,14
62	Hologic Inc	5.020	0,13
11	HubSpot Inc	5.853	0,15
1.289	Identiv Inc	10.841	0,29
74	Illumina Inc	13.874	0,37
347	Incyte Corp	21.601	0,57
30	Insulet Corp	8.650	0,23
113	Integra LifeSciences Holdings Corp	4.648	0,12
26	International Business Machines Corp	3.479	0,09
7	Intuit Inc	3.207	0,08
54	Intuitive Surgical Inc	18.465	0,49
2.175	IonQ Inc	29.428	0,77
49	IPG Photonics Corp	6.655	0,18
24	IQVIA Holdings Inc	5.394	0,14
98	iRhythm Technologies Inc	10.223	0,27
148	Itron Inc	10.671	0,28
123	Ivanhoe Electric Inc / US	1.604	0,04
25	John Bean Technologies Corp	3.033	0,08
33	Kadant Inc	7.329	0,19
8	Lam Research Corp	5.143	0,14
158	Lemonade Inc	2.662	0,07
54	Lindsay Corp	6.444	0,17
714	Livent Corp	19.585	0,52
457	Luminar Technologies Inc - Class A	3.144	0,08
91	Manhattan Associates Inc	18.189	0,48
25	Masimo Corp	4.114	0,11
31	Medpace Holdings Inc	7.445	0,20
3	MercadoLibre Inc	3.554	0,09
5	Mettler-Toledo International Inc	6.558	0,17
41	Microchip Technology Inc	3.673	0,10
14	Microsoft Corp	4.768	0,13
106	Middlesex Water Co	8.550	0,22

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
1.171	Mitek Systems Inc	12.694	0,33
47	Moderna Inc	5.711	0,15
17	MongoDB Inc - Class A	6.987	0,18
543	Mueller Water Products Inc - Class A	8.813	0,23
509	NanoString Technologies Inc	2.061	0,05
119	Natera Inc	5.791	0,15
84	National Instruments Corp	4.822	0,13
10	Netflix Inc	4.405	0,12
371	NetScout Systems Inc	11.482	0,30
201	Nevro Corp	5.109	0,13
45	New Relic Inc	2.945	0,08
17	Nordson Corp	4.219	0,11
60	Northwest Pipe Co	1.814	0,05
34	NVIDIA Corp	14.383	0,38
162	Okta Inc	11.235	0,30
197	Omniceil Inc	14.513	0,38
818	OneSpan Inc	12.139	0,32
136	Oracle Corp	16.196	0,43
153	Ormat Technologies Inc	12.310	0,32
98	Palo Alto Networks Inc	25.040	0,66
26	Penumbra Inc	8.946	0,24
181	Privia Health Group Inc	4.726	0,12
91	Prologis Inc (REIT)	11.159	0,29
29	PTC Inc	4.127	0,11
455	PTC Therapeutics Inc	18.505	0,49
205	Pure Storage Inc	7.548	0,20
33	QUALCOMM Inc	3.928	0,10
101	Qualys Inc	13.046	0,34
60	QuidelOrtho Corp	4.972	0,13
3.913	Rackspace Technology Inc	10.643	0,28
328	Rapid7 Inc	14.852	0,39
10	Regeneron Pharmaceuticals Inc	7.185	0,19
62	Revvity Inc	7.365	0,19
19	Roper Technologies Inc	9.135	0,24

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
113	Ryder System Inc	9.581	0,25
19	Salesforce Inc	4.014	0,11
408	Samsara Inc	11.306	0,30
130	Sarepta Therapeutics Inc	14.888	0,39
766	SentinelOne Inc	11.567	0,30
20	ServiceNow Inc	11.239	0,30
100	SJW Group	7.011	0,18
18	Snowflake Inc	3.168	0,08
140	SolarEdge Technologies Inc	37.667	0,99
1.165	SolarWinds Corp	11.953	0,31
35	Splunk Inc	3.713	0,10
71	SPS Commerce Inc	13.636	0,36
143	STAAR Surgical Co	7.518	0,20
26	Stryker Corp	7.932	0,21
311	Tactile Systems Technology Inc	7.753	0,20
110	TD SYNEX Corp	10.340	0,27
100	Teladoc Health Inc	2.532	0,07
3.005	Telos Corp	7.693	0,20
290	Tenable Holdings Inc	12.630	0,33
80	Teradyne Inc	8.906	0,23
199	Tesla Inc	52.092	1,37
15	Thermo Fisher Scientific Inc	7.826	0,21
896	Traverse Therapeutics Inc	13.763	0,36
230	Trimble Inc	12.176	0,32
49	Twilio Inc - Class A	3.117	0,08
313	Twist Bioscience Corp	6.404	0,17
440	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	20.297	0,53
58	United Parcel Service Inc - Class B	10.397	0,27
81	United Therapeutics Corp	17.881	0,47
127	Varonis Systems Inc - Class B	3.385	0,09
54	Veeva Systems Inc - Class A	10.677	0,28
359	Veracyte Inc	9.144	0,24
19	Verisk Analytics Inc - Class A	4.295	0,11
89	Vertex Pharmaceuticals Inc	31.320	0,82

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
62	Walmart Inc	9.745	0,26
44	Watts Water Technologies Inc - Class A	8.084	0,21
630	Xencor Inc	15.731	0,41
161	Xylem Inc/NY	18.132	0,48
325	Yext Inc	3.676	0,10
81	York Water Co/The	3.343	0,09
13	Zebra Technologies Corp	3.846	0,10
93	Zscaler Inc	13.606	0,36
368	Zurn Elkay Water Solutions Corp	9.896	0,26
Vereinigte Staaten insgesamt		1.909.401	50,23
Stammaktien insgesamt		3.773.234	99,27
Vorzugsaktien			
Deutschland			
159	Volkswagen AG - Preference	21.326	0,56
Deutschland insgesamt		21.326	0,56
Vorzugsaktien insgesamt		21.326	0,56
Gesamtanlagen			
Stammaktien		3.773.234	99,27
Vorzugsaktien		21.326	0,56
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		6.431	0,17
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		3.800.991	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,78
Sonstige Vermögenswerte			0,22
			100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien			
Cayman-Inseln			
54	Ambarella Inc	4.518	0,17
Cayman-Inseln insgesamt		4.518	0,17
Finnland			
7.690	Nokia Oyj	32.179	1,23
Finnland insgesamt		32.179	1,23
Frankreich			
1.025	Dassault Systemes SE	45.430	1,73
Frankreich insgesamt		45.430	1,73
Deutschland			
79	Nemetschek SE	5.916	0,23
Deutschland insgesamt		5.916	0,23
Hongkong			
10.234	Lenovo Group Ltd	10.670	0,41
Hongkong insgesamt		10.670	0,41
Japan			
267	Capcom Co Ltd	10.521	0,40
Japan insgesamt		10.521	0,40
Norwegen			
250	Nordic Semiconductor ASA	3.044	0,12
Norwegen insgesamt		3.044	0,12
Südkorea			
50	Krafton Inc	7.392	0,28

L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Südkorea (Fortsetzung)			
201	NAVER Corp	27.885	1,07
2.190	Samsung Electronics Co Ltd	120.000	4,58
Südkorea insgesamt		155.277	5,93
Schweden			
2.878	Hexagon AB	35.371	1,35
4.379	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	23.680	0,90
Schweden insgesamt		59.051	2,25
Taiwan			
1.115	HTC Corp	2.044	0,08
2.269	MediaTek Inc	50.123	1,91
6.095	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	112.724	4,30
Taiwan insgesamt		164.891	6,29
Vereinigte Staaten			
291	Adobe Inc	142.296	5,43
1.315	Advanced Micro Devices Inc	149.792	5,72
226	Akamai Technologies Inc	20.311	0,78
74	Altair Engineering Inc - Class A	5.612	0,21
124	ANSYS Inc	40.953	1,56
369	Arista Networks Inc	59.800	2,28
308	Autodesk Inc	63.020	2,41
347	Bentley Systems Inc - Class B	18.818	0,72
766	Block Inc	50.993	1,95
183	Broadcom Inc	158.740	6,06
212	Ciena Corp	9.008	0,34
406	Cloudflare Inc	26.540	1,01
234	Coinbase Global Inc	16.743	0,64

L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
132	Equinix Inc (REIT)	103.480	3,95
187	Extreme Networks Inc	4.871	0,19
164	Fastly Inc	2.586	0,10
919	Fortinet Inc	69.467	2,65
1.834	Hewlett Packard Enterprise Co	30.811	1,18
37	Impinj Inc	3.317	0,13
42	InterDigital Inc	4.055	0,16
463	Juniper Networks Inc	14.506	0,55
255	Keysight Technologies Inc	42.700	1,63
97	Lumentum Holdings Inc	5.503	0,21
1.215	Marvell Technology Inc	72.633	2,77
615	Meta Platforms Inc - Class A	176.493	6,74
1.549	Micron Technology Inc	97.757	3,73
415	Microsoft Corp	141.324	5,39
490	NVIDIA Corp	207.280	7,91
429	Palo Alto Networks Inc	109.614	4,18
152	PTC Inc	21.630	0,83
839	QUALCOMM Inc	99.874	3,81
153	Rambus Inc	9.818	0,37
658	ROBLOX Corp	26.517	1,01
90	Semtech Corp	2.291	0,09
1.825	Snap Inc	21.608	0,82
57	Synaptics Inc	4.867	0,19
352	Trimble Inc	18.635	0,71
362	Unity Software Inc	15.718	0,60
323	Viavi Solutions Inc	3.660	0,14
321	VMware Inc	46.124	1,76
Vereinigte Staaten insgesamt		2.119.765	80,91
Stammaktien insgesamt		2.611.262	99,67

L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	2.611.262	99,67
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	8.585	0,33
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	2.619.847	100,00
Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,65
Sonstige Vermögenswerte		0,35
		100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien			
Deutschland			
4.612	Infineon Technologies AG	190.124	2,43
Deutschland insgesamt		190.124	2,43
Israel			
1.429	Check Point Software Technologies Ltd	179.511	2,30
1.256	CyberArk Software Ltd	196.350	2,51
8.284	Radware Ltd	160.627	2,06
Israel insgesamt		536.488	6,87
Japan			
17.159	Renesas Electronics Corp	320.718	4,11
3.827	Trend Micro Inc/Japan	183.890	2,35
Japan insgesamt		504.608	6,46
Niederlande			
960	NXP Semiconductors NV	196.493	2,52
3.664	STMicroelectronics NV	182.144	2,33
Niederlande insgesamt		378.637	4,85
Taiwan			
50.701	Elan Microelectronics Corp	165.235	2,12
3.196	eMemory Technology Inc	226.787	2,90
Taiwan insgesamt		392.022	5,02
Vereinigtes Königreich			
62.319	Darktrace Plc	244.184	3,13
40.291	GB Group Plc	117.303	1,50
Vereinigtes Königreich insgesamt		361.487	4,63

L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten			
11.377	A10 Networks Inc	165.990	2,12
2.132	Advanced Micro Devices Inc	242.856	3,11
1.390	Arista Networks Inc	225.263	2,88
307	Broadcom Inc	266.301	3,41
3.088	Cloudflare Inc	201.863	2,58
1.615	CrowdStrike Holdings Inc	237.195	3,04
4.342	Dell Technologies Inc	234.946	3,01
3.885	Dynatrace Inc	199.961	2,56
1.204	F5 Inc	176.097	2,25
16.203	Fastly Inc	255.521	3,27
3.461	Fortinet Inc	261.617	3,35
19.418	Identiv Inc	163.305	2,09
33.349	IonQ Inc	451.212	5,78
17.190	Mitek Systems Inc	186.340	2,39
5.755	NetScout Systems Inc	178.117	2,28
2.368	Okta Inc	164.221	2,10
12.589	OneSpan Inc	186.821	2,39
1.148	Palo Alto Networks Inc	293.325	3,76
1.492	Qualys Inc	192.722	2,47
55.246	Rackspace Technology Inc	150.269	1,92
3.667	Rapid7 Inc	166.042	2,13
11.675	SentinelOne Inc	176.292	2,26
17.287	SolarWinds Corp	177.365	2,27
37.509	Telos Corp	96.023	1,23
4.235	Tenable Holdings Inc	184.434	2,36
1.359	Zscaler Inc	198.822	2,55
	Vereinigte Staaten insgesamt	5.432.920	69,56
	Stammaktien insgesamt	7.796.286	99,82

L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	7.796.286	99,82
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	14.293	0,18
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	7.810.579	100,00

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,78
Sonstige Vermögenswerte	0,22
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien			
Australien			
14.801	Alumina Ltd	13.646	0,35
4.639	ANZ Group Holdings Ltd	73.217	1,89
1.037	Aristocrat Leisure Ltd	26.687	0,69
333	ASX Ltd	13.965	0,36
7.605	Atlas Arteria Ltd	31.437	0,81
11.323	Aurizon Holdings Ltd	29.546	0,76
8.574	Brambles Ltd	82.244	2,12
432	carsales.com Ltd	6.850	0,18
2.996	Charter Hall Group (REIT)	21.359	0,55
410	Cochlear Ltd	62.518	1,61
8.000	Coles Group Ltd	98.092	2,53
2.557	Commonwealth Bank of Australia	170.670	4,40
892	Computershare Ltd	13.882	0,36
734	CSL Ltd	135.527	3,49
1.587	Dexus (REIT)	8.240	0,21
41	Domino's Pizza Enterprises Ltd	1.267	0,03
8.531	Endeavour Group Ltd/Australia	35.833	0,92
11.629	Evolution Mining Ltd	24.926	0,64
2.847	Goodman Group (REIT)	38.035	0,98
12.000	GPT Group/The (REIT)	33.070	0,85
142	IDP Education Ltd	2.089	0,05
3.977	IGO Ltd	40.240	1,04
3.851	Insurance Australia Group Ltd	14.612	0,38
1.168	Lendlease Corp Ltd	6.026	0,15
3.661	Lottery Corp Ltd/The	12.502	0,32
5.497	Lynas Rare Earths Ltd	25.065	0,65
541	Macquarie Group Ltd	63.965	1,65
4.366	Medibank Pvt Ltd	10.230	0,26

L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Australien (Fortsetzung)			
1.044	Mineral Resources Ltd	49.640	1,28
24.908	Mirvac Group (Units) (REIT)	37.472	0,97
5.092	National Australia Bank Ltd	89.383	2,30
5.575	Newcrest Mining Ltd	98.046	2,53
7.139	Northern Star Resources Ltd	57.406	1,48
2.694	Orica Ltd	26.595	0,68
11.871	Qantas Airways Ltd	48.993	1,26
2.444	QBE Insurance Group Ltd	25.493	0,66
311	Ramsay Health Care Ltd	11.653	0,30
111	REA Group Ltd	10.568	0,27
1.807	Reece Ltd	22.337	0,58
8.006	Scentre Group (REIT)	14.123	0,36
525	SEEK Ltd	7.591	0,20
697	Seven Group Holdings Ltd	11.437	0,29
720	Sonic Healthcare Ltd	17.048	0,44
15.415	Stockland (REIT)	41.353	1,06
2.075	Suncorp Group Ltd	18.633	0,48
18.162	Telstra Group Ltd	51.986	1,34
248	TPG Telecom Ltd	804	0,02
19.544	Transurban Group	185.388	4,78
4.493	Treasury Wine Estates Ltd	33.587	0,86
5.674	Vicinity Ltd (REIT)	6.968	0,18
1.650	Wesfarmers Ltd	54.192	1,40
5.625	Westpac Banking Corp	79.904	2,06
289	WiseTech Global Ltd	15.354	0,40
7.400	Woolworths Group Ltd	195.706	5,04
	Australien insgesamt	2.307.400	59,45

L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Bermuda			
30.000	Alibaba Health Information Technology Ltd	18.031	0,46
1.600	Hongkong Land Holdings Ltd	6.240	0,16
	Bermuda insgesamt	24.271	0,62
Cayman-Inseln			
9.700	Budweiser Brewing Co APAC Ltd '144A'	25.003	0,64
18.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	67.759	1,74
10.800	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	19.404	0,50
3.000	CK Asset Holdings Ltd	16.615	0,43
3.600	ESR Group Ltd '144A'	6.174	0,16
153	Futu Holdings Ltd ADR	6.080	0,16
35.000	Geely Automobile Holdings Ltd	42.697	1,10
2.637	Grab Holdings Ltd	9.045	0,23
4.000	HKT Trust & HKT Ltd	4.650	0,12
4.400	Sands China Ltd	14.991	0,39
469	Sea Ltd ADR	27.221	0,70
59.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	25.673	0,66
2.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	9.992	0,26
10.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	15.568	0,40
	Cayman-Inseln insgesamt	290.872	7,49
Hongkong			
16.800	AIA Group Ltd	169.574	4,37
3.500	BYD Electronic International Co Ltd	10.585	0,27
2.000	Cathay Pacific Airways Ltd	2.044	0,05
52.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	45.188	1,16
1.000	Fosun International Ltd	687	0,02
3.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	19.026	0,49

L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Hongkong (Fortsetzung)			
3.000	Hang Lung Properties Ltd	4.632	0,12
1.200	Hang Seng Bank Ltd	17.074	0,44
2.000	Henderson Land Development Co Ltd	5.946	0,15
1.800	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	67.805	1,75
3.960	Link REIT (Units) (REIT)	21.981	0,57
9.500	MTR Corp Ltd	43.641	1,12
2.000	New World Development Co Ltd	4.921	0,13
4.000	Sino Land Co Ltd	4.915	0,13
2.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	25.190	0,65
2.500	Swire Pacific Ltd	3.149	0,08
1.000	Swire Pacific Ltd	7.663	0,20
1.800	Swire Properties Ltd	4.424	0,11
8.500	Techtronic Industries Co Ltd	92.358	2,38
6.000	Wharf Holdings Ltd/The	14.256	0,37
	Hongkong insgesamt	565.059	14,56
Neuseeland			
4.140	a2 Milk Co Ltd/The	13.570	0,35
7.851	Auckland International Airport Ltd	41.125	1,06
256	Chorus Ltd	1.321	0,03
4.761	Contact Energy Ltd	23.627	0,61
1.108	EBOS Group Ltd	24.947	0,64
3.433	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	51.530	1,33
4.318	Infratil Ltd	26.851	0,69
543	Mainfreight Ltd	23.952	0,62
4.178	Mercury NZ Ltd	16.638	0,43
7.802	Meridian Energy Ltd	26.768	0,69
296	Ryman Healthcare Ltd	1.193	0,03

L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Neuseeland (Fortsetzung)			
3.448	Spark New Zealand Ltd	10.752	0,28
211	Xero Ltd	16.704	0,43
Neuseeland insgesamt		278.978	7,19
Singapur			
5.800	CapitaLand Ascendas REIT (Units) (REIT)	11.657	0,30
610	CapitaLand Ascott Trust (Units)	487	0,01
8.600	CapitaLand Integrated Commercial Trust (Units) (REIT)	12.137	0,31
4.000	CapitaLand Investment Ltd/Singapore	9.783	0,25
700	City Developments Ltd	3.476	0,09
3.000	DBS Group Holdings Ltd	69.848	1,80
5.100	Frasers Logistics & Commercial Trust (Units) (REIT)	4.711	0,12
8.300	Genting Singapore Ltd	5.765	0,15
2.300	Keppel DC REIT (Units) (REIT)	3.671	0,09
3.300	Mapletree Industrial Trust (Units) (REIT)	5.389	0,14
5.700	Mapletree Logistics Trust (Units) (REIT)	6.823	0,18
3.800	Mapletree Pan Asia Commercial Trust (REIT)	4.549	0,12
6.000	Olam Group Ltd	6.162	0,16
4.600	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	41.739	1,08
5.923	SATS Ltd	11.291	0,29
402.900	Seatrium Ltd	37.213	0,96
8.000	Singapore Airlines Ltd	42.265	1,09
1.100	Singapore Exchange Ltd	7.811	0,20
14.000	Singapore Telecommunications Ltd	25.861	0,67
11.300	Suntec Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	10.771	0,28
1.900	United Overseas Bank Ltd	39.309	1,01
900	UOL Group Ltd	4.269	0,11

L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Singapur (Fortsetzung)			
1.400	Venture Corp Ltd	15.217	0,39
12.300	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	13.633	0,35
Singapur insgesamt		393.837	10,15
Stammaktien insgesamt		3.860.417	99,46
Gesamtanlagen			
Stammaktien		3.860.417	99,46
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		20.913	0,54
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		3.881.330	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,45	
Sonstige Vermögenswerte		0,55	
		100,00	
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien			
Japan			
700	Acom Co Ltd	1.689	0,04
305	Advantest Corp	40.411	0,97
1.171	Aeon Co Ltd	23.836	0,57
200	Aeon Mall Co Ltd	2.575	0,06
600	Amada Co Ltd	5.866	0,14
822	Asahi Group Holdings Ltd	31.700	0,76
300	Asahi Intecc Co Ltd	5.835	0,14
2.794	Astellas Pharma Inc	41.542	0,99
200	Azbil Corp	6.270	0,15
863	Bandai Namco Holdings Inc	19.829	0,47
200	BayCurrent Consulting Inc	7.428	0,18
297	Capcom Co Ltd	11.702	0,28
400	Casio Computer Co Ltd	3.268	0,08
299	Central Japan Railway Co	37.361	0,89
1.200	Chiba Bank Ltd/The	7.256	0,17
1.027	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	29.033	0,69
1.900	Concordia Financial Group Ltd	7.396	0,18
29	Cosmos Pharmaceutical Corp	2.923	0,07
800	CyberAgent Inc	5.801	0,14
500	Daifuku Co Ltd	10.179	0,24
1.576	Dai-ichi Life Holdings Inc	29.855	0,71
3.103	Daiichi Sankyo Co Ltd	97.683	2,34
956	Daiwa House Industry Co Ltd	25.081	0,60
4	Daiwa House REIT Investment Corp (REIT)	7.644	0,18
2.400	Daiwa Securities Group Inc	12.293	0,29
327	Dentsu Group Inc	10.663	0,26
144	Disco Corp	22.526	0,54
591	East Japan Railway Co	32.659	0,78
100	Ebara Corp	4.748	0,11
424	Eisai Co Ltd	28.526	0,68

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
1.513	FANUC Corp	52.675	1,26
264	Fast Retailing Co Ltd	67.071	1,61
200	Food & Life Cos Ltd	3.876	0,09
327	Fujitsu Ltd	42.070	1,01
300	Fukuoka Financial Group Inc	6.171	0,15
9	GLP J-Reit (REIT)	8.848	0,21
100	GMO Payment Gateway Inc	7.749	0,19
400	Hakuhodo DY Holdings Inc	4.184	0,10
200	Hamamatsu Photonics KK	9.722	0,23
300	Hankyu Hanshin Holdings Inc	9.870	0,24
100	Harmonic Drive Systems Inc	3.190	0,08
33	Hikari Tsushin Inc	4.703	0,11
49	Hirose Electric Co Ltd	6.467	0,15
100	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	2.608	0,06
200	Hoshizaki Corp	7.135	0,17
598	Hoya Corp	70.646	1,69
800	Hulic Co Ltd	6.814	0,16
204	Ibiden Co Ltd	11.433	0,27
600	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	6.069	0,15
100	Ito En Ltd	2.746	0,07
100	Itochu Techno-Solutions Corp	2.516	0,06
400	J Front Retailing Co Ltd	3.815	0,09
818	Japan Exchange Group Inc	14.194	0,34
14	Japan Metropolitan Fund Invest (REIT)	9.328	0,22
800	Japan Post Bank Co Ltd	6.221	0,15
3.667	Japan Post Holdings Co Ltd	26.297	0,63
400	Japan Post Insurance Co Ltd	5.996	0,14
300	JSR Corp	8.531	0,20
200	Kakaku.com Inc	2.855	0,07
727	Kao Corp	26.226	0,63
2.500	KDDI Corp	76.971	1,84

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
200	Keihan Holdings Co Ltd	5.247	0,13
400	Keikyu Corp	3.520	0,08
200	Keio Corp	6.259	0,15
259	Keisei Electric Railway Co Ltd	10.673	0,26
312	Keyence Corp	146.464	3,51
257	Kikkoman Corp	14.566	0,35
300	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	10.345	0,25
1.400	Kirin Holdings Co Ltd	20.356	0,49
100	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	5.411	0,13
193	Kobe Bussan Co Ltd	4.975	0,12
200	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	3.439	0,08
164	Konami Group Corp	8.534	0,20
54	Kose Corp	5.152	0,12
556	Kyocera Corp	29.971	0,72
500	Kyowa Kirin Co Ltd	9.216	0,22
200	Kyushu Railway Co	4.285	0,10
132	Lasertec Corp (Units)	19.704	0,47
100	Lawson Inc	4.419	0,11
500	Lion Corp	4.644	0,11
780	M3 Inc	16.778	0,40
452	Makita Corp	12.622	0,30
300	Marui Group Co Ltd	5.206	0,12
200	MatsukiyoCocokara & Co	11.177	0,27
100	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	3.881	0,09
1.800	Mebuki Financial Group Inc	4.254	0,10
100	Mercari Inc	2.324	0,06
604	MINEBEA MITSUMI Inc	11.304	0,27
600	MISUMI Group Inc	11.910	0,29
2.222	Mitsubishi Estate Co Ltd	26.289	0,63
1.300	Mitsubishi HC Capital Inc	7.686	0,18
19.221	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	141.629	3,39

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
1.471	Mitsui Fudosan Co Ltd	29.113	0,70
100	Miura Co Ltd	2.588	0,06
3.953	Mizuho Financial Group Inc	60.142	1,44
400	MonotaRO Co Ltd	5.045	0,12
599	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	21.119	0,51
1.014	Murata Manufacturing Co Ltd	57.780	1,38
300	Nagoya Railroad Co Ltd	4.799	0,11
362	NEC Corp	17.444	0,42
780	Nexon Co Ltd	14.824	0,35
763	NIDEC CORP	41.414	0,99
600	Nihon M&A Center Holdings Inc	4.560	0,11
500	Nikon Corp	6.426	0,15
1.900	Nintendo Co Ltd	85.999	2,06
3	Nippon Building Fund Inc (REIT)	11.748	0,28
1.366	Nippon Paint Holdings Co Ltd	11.181	0,27
4	Nippon Prologis REIT Inc (REIT)	8.006	0,19
140	Nippon Shinyaku Co Ltd	5.690	0,14
87.850	Nippon Telegraph & Telephone Corp	103.632	2,48
200	Nippon Television Holdings Inc	1.894	0,05
200	Nissan Chemical Corp	8.536	0,20
154	Nitori Holdings Co Ltd	17.160	0,41
4.556	Nomura Holdings Inc	17.249	0,41
200	Nomura Real Estate Holdings Inc	4.724	0,11
8	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	9.194	0,22
642	Nomura Research Institute Ltd	17.594	0,42
1.024	NTT Data Group Corp	14.219	0,34
109	Obic Co Ltd	17.375	0,42
500	Odakyu Electric Railway Co Ltd	6.661	0,16
2.078	Olympus Corp	32.579	0,78
320	Omron Corp	19.412	0,46
700	Ono Pharmaceutical Co Ltd	12.621	0,30

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
100	Open House Group Co Ltd	3.575	0,09
58	Oracle Corp Japan	4.290	0,10
1.799	Oriental Land Co Ltd/Japan	69.715	1,67
1.964	ORIX Corp	35.500	0,85
5	Orix JREIT Inc (REIT)	6.137	0,15
200	Otsuka Corp	7.731	0,19
701	Otsuka Holdings Co Ltd	25.565	0,61
600	Pan Pacific International Holdings Corp	10.681	0,26
200	Park24 Co Ltd	2.701	0,06
300	Persol Holdings Co Ltd	5.374	0,13
100	Pola Orbis Holdings Inc	1.449	0,03
100	Rakus Co Ltd	1.681	0,04
2.000	Rakuten Group Inc	6.905	0,17
2.297	Recruit Holdings Co Ltd	72.517	1,74
1.939	Renesas Electronics Corp	36.242	0,87
4.223	Resona Holdings Inc	20.169	0,48
141	Rohm Co Ltd	13.189	0,32
294	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	6.593	0,16
400	Ryohin Keikaku Co Ltd	3.937	0,09
500	Santen Pharmaceutical Co Ltd	4.239	0,10
500	SBI Holdings Inc	9.577	0,23
100	SBI Shinsei Bank Ltd	1.945	0,05
74	SCREEN Holdings Co Ltd	8.315	0,20
200	SCSK Corp	3.127	0,07
320	Secom Co Ltd	21.562	0,52
200	Sega Sammy Holdings Inc	4.251	0,10
400	Seibu Holdings Inc	4.101	0,10
800	Seven Bank Ltd	1.567	0,04
700	SG Holdings Co Ltd	9.916	0,24
500	Shimadzu Corp	15.318	0,37
127	Shimano Inc	21.053	0,50

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
3.085	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	101.770	2,44
100	Shinko Electric Industries Co Ltd	4.049	0,10
502	Shionogi & Co Ltd	21.082	0,50
660	Shiseido Co Ltd	29.649	0,71
900	Shizuoka Financial Group Inc	6.470	0,15
91	SMC Corp	50.041	1,20
4.539	SoftBank Corp	48.362	1,16
1.490	SoftBank Group Corp	69.822	1,67
500	Sohgo Security Services Co Ltd	2.817	0,07
506	Sompo Holdings Inc	22.612	0,54
2.046	Sony Group Corp	183.529	4,39
100	Square Enix Holdings Co Ltd	4.627	0,11
100	Sugi Holdings Co Ltd	4.442	0,11
600	SUMCO Corp	8.419	0,20
2.097	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	89.358	2,14
505	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	17.865	0,43
400	Sumitomo Pharma Co Ltd	1.768	0,04
500	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	12.291	0,29
100	Sundrug Co Ltd	2.953	0,07
260	Systemex Corp	17.633	0,42
850	T&D Holdings Inc	12.382	0,30
100	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	3.747	0,09
170	Taiyo Yuden Co Ltd	4.807	0,12
2.489	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	77.958	1,87
100	TBS Holdings Inc	1.814	0,04
1.172	Terumo Corp	36.992	0,89
400	TIS Inc	9.938	0,24
300	Tobu Railway Co Ltd	8.008	0,19
200	Toho Co Ltd/Tokyo	7.570	0,18
2.915	Tokio Marine Holdings Inc	66.857	1,60
100	Tokyo Century Corp	3.581	0,09

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
755	Tokyo Electron Ltd	107.398	2,57
900	Tokyu Corp	10.800	0,26
900	Tokyu Fudosan Holdings Corp	5.126	0,12
292	TOTO Ltd	8.738	0,21
12.876	Toyota Motor Corp	205.654	4,92
200	Trend Micro Inc/Japan	9.610	0,23
100	Tsuruha Holdings Inc	7.407	0,18
666	Unicharm Corp	24.611	0,59
6	United Urban Investment Corp (REIT)	6.036	0,14
300	USS Co Ltd	4.936	0,12
100	Welcia Holdings Co Ltd	2.073	0,05
400	West Japan Railway Co	16.577	0,40
300	Yamaha Corp	11.428	0,27
412	Yaskawa Electric Corp	18.765	0,45
300	Yokogawa Electric Corp	5.501	0,13
5.000	Z Holdings Corp	11.983	0,29
200	ZOZO Inc	4.111	0,10
	Japan insgesamt	4.166.432	99,72
	Stammaktien insgesamt	4.166.432	99,72
Gesamtanlagen			
	Stammaktien	4.166.432	99,72
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	11.883	0,28
	Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	4.178.315	100,00
Analyse des Gesamtvermögens			% des Gesamtvermögens
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,70
	Sonstige Vermögenswerte		0,30
			100,00
	Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien			
Australien			
267	Allkem Ltd	2.847	0,02
408	ALS Ltd	3.031	0,02
4.689	AMP Ltd	3.527	0,02
539	ANZ Group Holdings Ltd	8.507	0,06
142	Aristocrat Leisure Ltd	3.654	0,02
854	Atlas Arteria Ltd	3.530	0,02
1.735	Bapcor Ltd	6.860	0,05
2.113	BHP Group Ltd	63.281	0,42
455	Brambles Ltd	4.365	0,03
214	Brickworks Ltd	3.798	0,03
285	carsales.com Ltd	4.519	0,03
830	Challenger Ltd	3.580	0,02
2.233	Cleanaway Waste Management Ltd	3.850	0,03
334	Commonwealth Bank of Australia	22.293	0,15
185	Computershare Ltd	2.879	0,02
256	Credit Corp Group Ltd	3.374	0,02
61	CSL Ltd	11.263	0,07
1.154	CSR Ltd	3.987	0,03
1.001	Evolution Mining Ltd	2.146	0,01
561	Fortescue Metals Group Ltd	8.283	0,05
275	IGO Ltd	2.783	0,02
740	Insurance Australia Group Ltd	2.808	0,02
83	Macquarie Group Ltd	9.814	0,06
83	Mineral Resources Ltd	3.947	0,03
678	National Australia Bank Ltd	11.901	0,08
338	Newcrest Mining Ltd	5.944	0,04
392	Northern Star Resources Ltd	3.152	0,02
778	Pilbara Minerals Ltd	2.533	0,02
85	Pro Medicus Ltd	3.714	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Australien (Fortsetzung)			
1.206	Qantas Airways Ltd	4.977	0,03
432	QBE Insurance Group Ltd	4.506	0,03
1.922	Qube Holdings Ltd	3.646	0,02
81	Ramsay Health Care Ltd	3.035	0,02
35	REA Group Ltd	3.332	0,02
109	Rio Tinto Ltd	8.322	0,06
1.584	Santos Ltd	7.929	0,05
2.732	Scentre Group (REIT)	4.819	0,03
304	SEEK Ltd	4.395	0,03
182	Sonic Healthcare Ltd	4.309	0,03
1.691	South32 Ltd	4.232	0,03
388	Suncorp Group Ltd	3.484	0,02
3.146	Telstra Group Ltd	9.005	0,06
505	Transurban Group	4.790	0,03
783	Webjet Ltd	3.602	0,02
164	Wesfarmers Ltd	5.387	0,04
708	Westpac Banking Corp	10.057	0,07
754	Woodside Energy Group Ltd	17.286	0,11
168	Woolworths Group Ltd	4.443	0,03
334	Worley Ltd	3.511	0,02
Australien insgesamt		331.237	2,18
Österreich			
117	Erste Group Bank AG	4.096	0,03
75	OMV AG	3.178	0,02
49	Verbund AG	3.927	0,03
110	Wienerberger AG	3.365	0,02
Österreich insgesamt		14.566	0,10

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Belgien			
31	Ackermans & van Haaren NV	5.100	0,03
68	Ageas SA/NV	2.753	0,02
336	Anheuser-Busch InBev SA/NV	19.000	0,13
43	D'iereen Group	7.595	0,05
89	Groupe Bruxelles Lambert NV	7.007	0,05
124	KBC Group NV	8.648	0,06
18	Sofina SA	3.725	0,02
34	Solvay SA	3.795	0,02
69	UCB SA	6.113	0,04
95	Umicore SA	2.652	0,02
	Belgien insgesamt	66.388	0,44
Bermuda			
6.000	Alibaba Health Information Technology Ltd	3.606	0,02
95	Arch Capital Group Ltd	7.111	0,05
127	Axalta Coating Systems Ltd	4.167	0,03
68	Bunge Ltd	6.416	0,04
1.000	China Resources Gas Group Ltd	3.420	0,02
500	CK Infrastructure Holdings Ltd	2.645	0,02
42	Credicorp Ltd	6.201	0,04
179	Essent Group Ltd	8.377	0,05
12	Everest Group Ltd	4.102	0,03
8.000	First Pacific Co Ltd	2.767	0,02
119	Flow Traders Ltd	2.625	0,02
97	Genpact Ltd	3.644	0,02
48	HAL Trust	6.138	0,04
600	Hongkong Land Holdings Ltd	2.340	0,02
231	Invesco Ltd	3.883	0,03
100	Jardine Matheson Holdings Ltd	5.065	0,03
1.500	Kerry Properties Ltd	3.108	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Bermuda (Fortsetzung)			
97	Lazard Ltd - Class A	3.104	0,02
3.000	NWS Holdings Ltd	3.403	0,02
14	RenaissanceRe Holdings Ltd	2.611	0,02
49	Triton International Ltd	4.080	0,03
Bermuda insgesamt		88.813	0,59
Brasilien			
1.300	AES Brasil Energia SA	3.301	0,02
900	Aliansce Sonae Shopping Centers sa	4.599	0,03
2.100	Ambev SA	6.708	0,04
900	Auren Energia SA	2.673	0,02
3.100	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	9.389	0,06
400	Banco Bradesco SA	1.214	0,01
800	Banco BTG Pactual SA (Units)	5.216	0,03
400	Banco do Brasil SA	4.096	0,03
400	BB Seguridade Participacoes SA	2.551	0,02
1.200	CCR SA	3.495	0,02
600	Centrais Eletricas Brasileiras SA	4.944	0,03
300	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP	3.518	0,02
500	Cia de Saneamento do Parana (Units)	2.266	0,01
1.900	Cia Siderurgica Nacional SA	4.778	0,03
1.100	Cosan SA	4.073	0,03
700	Embraer SA	2.690	0,02
400	Energisa S/A	4.163	0,03
300	Engie Brasil Energia SA	2.841	0,02
800	Equatorial Energia SA	5.332	0,03
500	Hypera SA	4.769	0,03
200	Itau Unibanco Holding SA	1.017	0,01
2.200	Klabin SA	9.928	0,07
500	Localiza Rent a Car SA	7.100	0,05

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Brasilien (Fortsetzung)			
600	Lojas Renner SA	2.488	0,02
1.500	Petroleo Brasileiro SA	10.292	0,07
400	PRIO SA/Brazil	3.075	0,02
700	Raia Drogasil SA	4.295	0,03
700	Rede D'Or Sao Luiz SA '144A'	4.777	0,03
700	Rumo SA	3.221	0,02
500	Suzano SA	4.583	0,03
800	WEG SA	6.260	0,04
Brasilien insgesamt		139.652	0,92
Britische Jungferninseln			
160	Hollysys Automation Technologies Ltd	2.814	0,02
150	Nomad Foods Ltd	2.628	0,02
Britische Jungferninseln insgesamt		5.442	0,04
Kanada			
140	Agnico Eagle Mines Ltd (Units)	6.999	0,05
213	Air Canada	4.023	0,03
269	Alamos Gold Inc - Class A	3.208	0,02
111	Alimentation Couche-Tard Inc	5.698	0,04
396	ARC Resources Ltd	5.288	0,04
753	B2Gold Corp	2.686	0,02
127	Bank of Montreal	11.483	0,08
220	Bank of Nova Scotia/The	11.020	0,07
620	Barrick Gold Corp	10.500	0,07
159	BCE Inc	7.258	0,05
648	BlackBerry Ltd	3.594	0,02
79	Brookfield Renewable Corp	2.490	0,02
189	Canadian Imperial Bank of Commerce	8.079	0,05
50	Canadian National Railway Co	6.062	0,04

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Kanada (Fortsetzung)			
459	Canadian Natural Resources Ltd	25.835	0,17
57	Canadian Pacific Kansas City Ltd	4.609	0,03
32	Canadian Tire Corp Ltd	4.380	0,03
200	Canfor Corp	3.594	0,02
40	CCL Industries Inc - Class B	1.968	0,01
731	Cenovus Energy Inc	12.430	0,08
617	Crescent Point Energy Corp	4.159	0,03
434	Element Fleet Management Corp	6.619	0,04
126	Emera Inc	5.195	0,03
331	Enbridge Inc	12.317	0,08
90	Exchange Income Corp	3.565	0,02
6	Fairfax Financial Holdings Ltd	4.499	0,03
230	First Quantum Minerals Ltd	5.447	0,04
177	Fortis Inc/Canada	7.636	0,05
20	Franco-Nevada Corp	2.854	0,02
88	GFL Environmental Inc	3.421	0,02
145	Hydro One Ltd '144A'	4.148	0,03
75	IGM Financial Inc	2.286	0,02
110	Imperial Oil Ltd	5.634	0,04
21	Intact Financial Corp	3.246	0,02
511	Ivanhoe Mines Ltd (Units)	4.673	0,03
580	Kinross Gold Corp	2.770	0,02
63	Linamar Corp	3.315	0,02
472	Lundin Mining Corp	3.703	0,03
144	Magna International Inc (Units)	8.139	0,05
327	Manulife Financial Corp	6.188	0,04
329	MEG Energy Corp	5.221	0,04
73	National Bank of Canada	5.445	0,04
19	Novanta Inc	3.498	0,02
234	Nutrien Ltd	13.831	0,09

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Kanada (Fortsetzung)			
113	Open Text Corp	4.705	0,03
114	Parkland Corp	2.843	0,02
200	Pembina Pipeline Corp	6.295	0,04
109	Rogers Communications Inc	4.979	0,03
216	Royal Bank of Canada	20.653	0,14
426	Shopify Inc - Class A	27.564	0,18
216	SNC-Lavalin Group Inc	5.672	0,04
77	Stantec Inc	5.033	0,03
93	Stella-Jones Inc	4.795	0,03
91	Sun Life Financial Inc	4.749	0,03
667	Suncor Energy Inc	19.588	0,13
220	TC Energy Corp	8.901	0,06
254	Teck Resources Ltd	10.699	0,07
367	TELUS Corp	7.150	0,05
16	Thomson Reuters Corp	2.163	0,01
26	TMX Group Ltd	586	0,00
325	Toronto-Dominion Bank/The	20.167	0,13
171	Tourmaline Oil Corp	8.066	0,05
87	Uni-Select Inc	3.093	0,02
35	Waste Connections Inc	5.008	0,03
63	West Fraser Timber Co Ltd (Units)	5.418	0,04
642	Whitecap Resources Inc	4.498	0,03
36	WSP Global Inc	4.762	0,03
	Kanada insgesamt	456.400	3,01
Cayman-Inseln			
2.000	AAC Technologies Holdings Inc	4.706	0,03
844	Alibaba Group Holding Ltd ADR	70.347	0,46
33	Ambarella Inc	2.761	0,02
600	ANTA Sports Products Ltd	6.129	0,04

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Cayman-Inseln (Fortsetzung)			
400	ASMPT Ltd	3.938	0,03
130	Autohome Inc ADR	3.791	0,02
39	BeiGene Ltd ADR	6.954	0,05
285	Bilibili Inc ADR	4.304	0,03
1.000	Chailease Holding Co Ltd	6.550	0,04
1.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	3.764	0,02
2.000	China Resources Land Ltd	8.473	0,06
2.000	China State Construction International Holdings Ltd	2.279	0,02
6.000	Chinasoft International Ltd	3.775	0,02
1.000	CK Asset Holdings Ltd	5.538	0,04
1.000	CK Hutchison Holdings Ltd	6.106	0,04
49	Daqo New Energy Corp ADR	1.945	0,01
600	ENN Energy Holdings Ltd	7.473	0,05
41	Fabrinet	5.325	0,04
516	Full Truck Alliance Co Ltd ADR	3.210	0,02
76	Futu Holdings Ltd ADR	3.020	0,02
13.000	GCL Technology Holdings Ltd	3.003	0,02
5.000	Geely Automobile Holdings Ltd	6.100	0,04
87	H World Group Ltd ADR	3.374	0,02
369	Hello Group Inc ADR	3.546	0,02
2.000	HKT Trust & HKT Ltd	2.325	0,02
1.000	Innovent Biologics Inc '144A'	3.777	0,02
518	JD.com Inc ADR	17.679	0,12
789	KE Holdings Inc ADR	11.717	0,08
5.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	6.687	0,04
1.400	Kingsoft Corp Ltd	5.511	0,04
1.000	Li Ning Co Ltd	5.379	0,04
1.500	Longfor Group Holdings Ltd '144A'	3.644	0,02
3.446	Lufax Holding Ltd ADR	4.928	0,03
2.000	Meituan '144A'	31.213	0,21

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Cayman-Inseln (Fortsetzung)			
576	NetEase Inc ADR	55.693	0,37
96	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	3.791	0,02
675	NIO Inc ADR	6.541	0,04
375	PDD Holdings Inc ADR	25.928	0,17
148	Qifu Technology Inc ADR	2.557	0,02
800	Sands China Ltd	2.726	0,02
500	Shenzhen International Group Holdings Ltd	4.769	0,03
10.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	4.351	0,03
169	StoneCo Ltd - Class A	2.153	0,01
1.000	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	9.972	0,07
324	TAL Education Group ADR	1.931	0,01
526	Trip.com Group Ltd ADR	18.410	0,12
304	Vipshop Holdings Ltd ADR	5.016	0,03
1.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	4.996	0,03
1.500	Wuxi Biologics Cayman Inc '144A'	7.187	0,05
20.800	Xiaomi Corp '144A'	28.453	0,19
164	XP Inc - Class A	3.847	0,03
1.000	Zhen Ding Technology Holding Ltd	3.371	0,02
249	ZTO Express Cayman Inc ADR	6.245	0,04
	Cayman-Inseln insgesamt	467.208	3,08
Chile			
62.128	Banco de Chile	6.482	0,04
	Chile insgesamt	6.482	0,04
China			
8.300	Agricultural Bank of China Ltd 'A'	4.027	0,03
7.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H'	2.751	0,02
8.000	AviChina Industry & Technology Co Ltd 'H'	3.879	0,03
41.000	Bank of China Ltd 'H'	16.428	0,11

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
China (Fortsetzung)			
5.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	3.311	0,02
16.400	Boe Technology Group Co Lt-A	9.220	0,06
200	Byd Co Ltd -A	7.100	0,05
500	BYD Co Ltd 'H'	15.951	0,10
15.000	CGN Power Co Ltd 'H' '144A'	3.618	0,02
6.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	2.818	0,02
44.000	China Construction Bank Corp 'H'	28.466	0,19
14.000	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H'	4.734	0,03
8.000	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	2.297	0,01
6.000	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	3.200	0,02
2.000	China International Capital Corp Ltd 'H' '144A'	3.507	0,02
5.000	China Life Insurance Co Ltd 'H'	8.333	0,05
3.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	3.089	0,02
1.200	China Merchants Bank 'A'	5.404	0,04
1.500	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	6.814	0,04
2.900	China Merchants Securities-A	5.410	0,04
2.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	5.168	0,03
8.000	China Southern Airlines Co Ltd 'H'	4.512	0,03
4.600	China State Construction Engineering Corp Ltd 'A'	3.630	0,02
6.500	China Three Gorges Renewab-A	4.798	0,03
80.000	China Tower Corp Ltd 'H' '144A'	8.881	0,06
1.800	China Yangtze Power Co Ltd 'A'	5.458	0,04
1.000	CITIC Securities Co Ltd 'H'	1.812	0,01
1.900	Citic Securities Co-A	5.166	0,03
200	Contemporary Amperex Techn-A	6.290	0,04
1.100	CSC Financial Co Ltd-A	3.659	0,02
2.300	East Money Information Co-A	4.489	0,03
1.300	Foxconn Industrial Interne-A	4.503	0,03
1.100	Fuyao Glass Industry Group-A	5.421	0,04
2.800	Guotai Junan Securities Co-A	5.385	0,04

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
China (Fortsetzung)			
1.800	Haier Smart Home Co Ltd 'H'	5.662	0,04
4.000	Haitong Securities Co Ltd-A	5.070	0,03
300	Iflytek Co Ltd 'A'	2.803	0,02
5.800	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A'	3.843	0,03
32.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	17.069	0,11
1.000	Longi Green Energy Technol-A	3.941	0,03
1.200	Luxshare Precision Industr-A	5.353	0,04
800	Nongfu Spring Co Ltd 'H' '144A'	4.415	0,03
4.000	PICC Property & Casualty Co Ltd 'H'	4.446	0,03
800	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	5.103	0,03
2.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	15.903	0,10
8.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' '144A'	4.921	0,03
2.100	Shanghai Baosight Software Co Ltd 'A'	5.544	0,04
8.400	Shenwan Hongyuan Group Co-	5.335	0,04
1.200	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	3.752	0,02
200	Sungrow Power Supply Co Lt-A	3.206	0,02
2.000	TravelSky Technology Ltd 'H'	3.394	0,02
200	Wuliangye Yibin Co Ltd-A	4.497	0,03
2.000	Zijin Mining Group Co Ltd 'H'	2.935	0,02
3.500	Zijin Mining Group Co Ltd-A	5.470	0,04
800	ZTE Corp 'H'	3.205	0,02
1.100	Zte Corp-A	6.886	0,05
China insgesamt		332.282	2,19
Kolumbien			
5.410	Ecopetrol SA	2.772	0,02
536	Interconexion Electrica SA ESP	2.168	0,01
Kolumbien insgesamt		4.940	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Curacao			
535	Schlumberger NV	26.279	0,17
Curacao insgesamt		26.279	0,17
Tschechische Republik			
160	Komerční Banka AS	4.882	0,03
1.269	Moneta Money Bank AS '144A'	4.650	0,03
Tschechische Republik insgesamt		9.532	0,06
Dänemark			
4.076	Alm Brand A/S	6.378	0,04
4	AP Moller - Maersk A/S - Class A	6.963	0,05
42	Carlsberg AS	6.711	0,04
26	Chr Hansen Holding A/S	1.804	0,01
17	Coloplast A/S	2.125	0,01
609	Danske Bank A/S	14.813	0,10
71	Demant A/S	3.001	0,02
90	DSV A/S	18.897	0,13
33	Genmab A/S	12.475	0,08
172	ISS A/S	3.635	0,02
34	Jyske Bank A/S	2.583	0,02
41	NKT A/S	2.486	0,02
248	Novo Nordisk A/S	39.950	0,26
43	Novozymes A/S	2.003	0,01
30	Orsted AS '144A'	2.834	0,02
215	Pandora A/S	19.191	0,13
34	Ringkjøbing Landbobank A/S	4.870	0,03
10	ROCKWOOL A/S	2.583	0,02
39	Schouw & Co A/S	3.080	0,02
22	SimCorp A/S	2.331	0,02
80	Sydbank AS	3.695	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Dänemark (Fortsetzung)			
175	Topdanmark AS	8.595	0,06
219	Tryg A/S	4.738	0,03
111	Vestas Wind Systems A/S	2.951	0,02
Dänemark insgesamt		178.692	1,18
Ägypten			
2.337	Commercial International Bank Egypt SAE	3.857	0,03
Ägypten insgesamt		3.857	0,03
Färöer Inseln			
49	Bakkafrost P/F	2.936	0,02
Färöer Inseln insgesamt		2.936	0,02
Finnland			
65	Elisa Oyj	3.471	0,02
80	Huhtamaki Oyj	2.624	0,02
199	Kemira Oyj	3.168	0,02
119	Kone Oyj - Class B	6.210	0,04
459	Metsa Board Oyj	3.385	0,02
775	Metso Oyj	9.339	0,06
240	Neste Oyj	9.232	0,06
1.309	Nokia Oyj	5.477	0,04
449	Nokian Renkaat Oyj	3.910	0,03
1.207	Nordea Bank Abp	13.124	0,09
78	Sampo Oyj - Class A	3.499	0,02
706	Stora Enso Oyj	8.184	0,05
754	UPM-Kymmene Oyj	22.433	0,15
273	Valmet Oyj	7.589	0,05
Finnland insgesamt		101.645	0,67

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Frankreich			
72	Air Liquide SA	12.898	0,09
642	ALD SA '144A'	6.868	0,05
96	Alstom SA	2.861	0,02
63	Amundi SA '144A'	3.715	0,02
37	Arkema SA	3.484	0,02
221	AXA SA	6.516	0,04
136	BNP Paribas SA	8.564	0,06
644	Bollore SE	4.012	0,03
93	Bouygues SA	3.121	0,02
227	Bureau Veritas SA	6.221	0,04
97	Capgemini SE	18.366	0,12
132	Cie de Saint-Gobain	8.026	0,05
235	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	6.938	0,05
104	Danone SA	6.370	0,04
17	Dassault Aviation SA	3.402	0,02
81	Dassault Systemes SE	3.590	0,02
205	Edenred	13.719	0,09
80	Eiffage SA	8.342	0,06
221	Elis SA	4.292	0,03
45	EssilorLuxottica SA	8.474	0,06
47	Eurazeo SE	3.305	0,02
37	Gaztransport Et Technigaz SA	3.764	0,02
15	Hermes International	32.567	0,21
84	Imerys SA	3.272	0,02
28	Ipsen SA	3.366	0,02
157	JCDecaux SE	3.128	0,02
22	Kering SA	12.135	0,08
157	Klepierre SA (REIT)	3.892	0,03
90	La Francaise des Jeux SAEM '144A'	3.539	0,02
161	Legrand SA	15.949	0,11

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Frankreich (Fortsetzung)			
55	L'Oreal SA	25.628	0,17
75	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	70.615	0,47
714	Orange SA	8.337	0,05
20	Pernod Ricard SA	4.416	0,03
93	Publicis Groupe SA	7.458	0,05
97	Renault SA	4.083	0,03
193	Rexel SA	4.761	0,03
34	Rothschild & Co	1.727	0,01
106	Sanofi	11.357	0,07
92	Schneider Electric SE	16.708	0,11
103	Societe Generale SA	2.674	0,02
135	SPIE SA	4.360	0,03
24	Teleperformance	4.018	0,03
1.254	TotalEnergies SE	71.895	0,47
154	Valeo	3.298	0,02
227	Vallourec SA	2.681	0,02
122	Veolia Environnement SA	3.853	0,03
70	Verallia SA '144A'	2.626	0,02
134	Vinci SA	15.552	0,10
438	Vivendi SE	4.017	0,03
61	Worldline SA/France '144A'	2.229	0,01
Frankreich insgesamt		496.989	3,28
Deutschland			
45	adidas AG	8.728	0,06
42	Allianz SE	9.769	0,06
42	Aurubis AG	3.599	0,02
576	BASF SE	27.946	0,18
179	Bayerische Motoren Werke AG	21.974	0,15
96	Brenntag SE	7.478	0,05

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Deutschland (Fortsetzung)			
734	Commerzbank AG	8.128	0,05
68	CompuGroup Medical SE & Co KGaA	3.345	0,02
93	Continental AG	7.011	0,05
141	Covestro AG '144A'	7.319	0,05
189	Daimler Truck Holding AG	6.805	0,04
110	Delivery Hero SE '144A'	4.849	0,03
802	Deutsche Bank AG	8.416	0,06
25	Deutsche Boerse AG	4.612	0,03
1.106	Deutsche Lufthansa AG	11.317	0,07
1.480	Deutsche Telekom AG	32.255	0,21
485	DHL Group	23.668	0,16
1.547	E.ON SE	19.713	0,13
126	Evonik Industries AG	2.396	0,02
199	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	9.503	0,06
351	Fresenius SE & Co KGaA	9.715	0,06
26	Gerresheimer AG	2.925	0,02
11	Hapag-Lloyd AG '144A'	2.231	0,01
139	Heidelberg Materials AG	11.404	0,08
14	Henkel AG & Co KGaA	985	0,01
418	Infineon Technologies AG	17.232	0,11
280	K+S AG	4.874	0,03
75	KION Group AG	3.016	0,02
82	LANXESS AG	2.469	0,02
64	LEG Immobilien SE	3.676	0,02
471	Mercedes-Benz Group AG	37.856	0,25
59	Merck KGaA	9.755	0,06
20	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	7.497	0,05
212	Nordex SE	2.573	0,02
39	Rheinmetall AG	10.671	0,07
97	SAP SE	13.243	0,09

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Deutschland (Fortsetzung)			
54	Scout24 SE '144A'	3.422	0,02
237	Siemens AG	39.442	0,26
260	Siemens Energy AG	4.590	0,03
56	Siemens Healthineers AG '144A'	3.169	0,02
681	thyssenkrupp AG	5.326	0,04
32	Vitesco Technologies Group AG	2.634	0,02
23	Volkswagen AG	3.837	0,03
18	Wacker Chemie AG	2.470	0,02
Deutschland insgesamt		433.843	2,86
Griechenland			
2.530	Eurobank Ergasias Services and Holdings SA	4.165	0,03
213	GEK Terna Holding Real Estate Construction SA	3.332	0,02
157	Mytilineos SA	5.540	0,04
458	National Bank of Greece SA	2.975	0,02
106	Terna Energy SA	2.336	0,01
Griechenland insgesamt		18.348	0,12
Hongkong			
4.400	AIA Group Ltd	44.412	0,29
1.600	Bank of East Asia Ltd/The	2.209	0,02
2.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	6.112	0,04
5.000	Cathay Pacific Airways Ltd	5.111	0,04
3.000	China Overseas Land & Investment Ltd	6.539	0,04
6.000	Fortune Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	4.318	0,03
1.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	6.342	0,04
4.000	Guangdong Investment Ltd	3.450	0,02
3.000	Hang Lung Group Ltd	4.548	0,03
2.000	Hang Lung Properties Ltd	3.088	0,02
300	Hang Seng Bank Ltd	4.268	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Hongkong (Fortsetzung)			
1.000	Henderson Land Development Co Ltd	2.973	0,02
7.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	6.047	0,04
200	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	7.534	0,05
1.000	Hua Hong Semiconductor Ltd '144A'	3.267	0,02
2.000	Hysan Development Co Ltd	4.880	0,03
12.000	Lenovo Group Ltd	12.511	0,08
1.200	Link REIT (Units) (REIT)	6.661	0,05
500	MTR Corp Ltd	2.297	0,02
500	Power Assets Holdings Ltd	2.619	0,02
92.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	23.127	0,15
6.000	Sino Land Co Ltd	7.373	0,05
1.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	12.595	0,08
2.500	Swire Pacific Ltd	3.149	0,02
1.400	Swire Properties Ltd	3.441	0,02
Hongkong insgesamt		188.871	1,25
Ungarn			
383	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	3.347	0,02
189	OTP Bank Nyrt	6.706	0,05
144	Richter Gedeon Nyrt	3.546	0,02
Ungarn insgesamt		13.599	0,09
Indonesien			
17.900	Aneka Tambang Tbk	2.328	0,02
8.300	Astra International Tbk PT	3.751	0,02
17.500	Bank Central Asia Tbk PT	10.680	0,07
15.600	Bank Mandiri Persero Tbk PT	5.411	0,04
2.600	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	1.587	0,01
34.300	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	12.411	0,08
41.600	Barito Pacific Tbk PT	2.067	0,01

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Indonesien (Fortsetzung)			
56.100	BFI Finance Indonesia Tbk PT	5.351	0,04
15.100	Chandra Asri Petrochemical Tbk PT	2.115	0,01
7.900	Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT	2.780	0,02
4.800	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk PT	2.721	0,02
4.700	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	3.111	0,02
3.500	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	2.644	0,02
7.400	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	3.628	0,02
4.200	Indosat Tbk PT	2.416	0,02
22.700	Kalbe Farma Tbk PT	3.104	0,02
19.000	Mitra Adiperkasa Tbk PT	2.142	0,01
20.200	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk PT	3.624	0,02
5.700	Pabrik Kertas Tjiwi Kimia Tbk PT	2.348	0,02
19.600	Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT	3.373	0,02
17.200	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	4.589	0,03
5.900	Vale Indonesia Tbk PT	2.479	0,02
	Indonesien insgesamt	84.660	0,56
Irland			
231	Accenture Plc - Class A	71.282	0,47
80	Adient Plc	3.066	0,02
51	Aon Plc	17.605	0,12
447	Bank of Ireland Group Plc	4.261	0,03
438	CRH Plc	24.132	0,16
60	Eaton Corp Plc	12.066	0,08
38	Flutter Entertainment Plc	7.639	0,05
155	Glanbia Plc	2.317	0,02
36	Horizon Therapeutics Plc	3.703	0,03
34	ICON Plc	8.507	0,06
292	James Hardie Industries Plc CDI	7.726	0,05
29	Jazz Pharmaceuticals Plc	3.595	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Irland (Fortsetzung)			
94	Johnson Controls International plc	6.405	0,04
77	Kerry Group Plc	7.509	0,05
76	Kingspan Group Plc	5.050	0,03
68	Linde Plc	25.913	0,17
155	Medtronic Plc	13.655	0,09
108	nVent Electric Plc	5.580	0,04
637	Ryanair Holdings Plc	11.964	0,08
84	Seagate Technology Holdings Plc	5.197	0,03
96	Smurfit Kappa Group Plc	3.198	0,02
16	STERIS Plc	3.600	0,02
43	Trane Technologies Plc	8.224	0,05
49	Weatherford International Plc	3.255	0,02
9	Willis Towers Watson Plc	2.119	0,01
Irland insgesamt		267.568	1,76
Isle of Man			
251	Entain Plc	4.059	0,02
349	Playtech Plc	2.618	0,02
Isle of Man insgesamt		6.677	0,04
Israel			
800	Bank Hapoalim BM	6.549	0,04
922	Bank Leumi Le-Israel BM	6.855	0,05
77	Check Point Software Technologies Ltd	9.673	0,06
43	CyberArk Software Ltd	6.722	0,04
17	Elbit Systems Ltd	3.536	0,02
214	Enlight Renewable Energy Ltd	3.757	0,03
1.022	Isracard Ltd	4.258	0,03
12	Israel Corp Ltd	3.140	0,02
1.053	Israel Discount Bank Ltd	5.221	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Israel (Fortsetzung)			
131	Mizrahi Tefahot Bank Ltd	4.353	0,03
22	Nice Ltd	4.488	0,03
40	Paz Oil Co Ltd	4.290	0,03
123	Plus500 Ltd	2.291	0,02
658	Shapir Engineering and Industry Ltd	4.527	0,03
80	Tower Semiconductor Ltd	2.947	0,02
Israel insgesamt		72.607	0,48
Italien			
63	Amplifon SpA	2.309	0,02
1.019	Anima Holding SpA '144A'	3.789	0,03
621	Assicurazioni Generali SpA	12.615	0,08
213	Azimut Holding SpA	4.591	0,03
165	Banca Generali SpA	5.670	0,04
398	Banca Mediolanum SpA	3.596	0,02
1.101	Banco BPM SpA	5.105	0,03
286	BFF Bank SpA '144A'	3.130	0,02
1.127	BPER Banca	3.421	0,02
208	Brembo SpA	3.082	0,02
30	Brunello Cucinelli SpA	2.638	0,02
293	Buzzi SpA	7.333	0,05
1.622	Enel SpA	10.915	0,07
1.871	Eni SpA	26.908	0,18
378	FinecoBank Banca Fineco SpA	5.079	0,03
295	Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A'	3.888	0,03
4.699	Intesa Sanpaolo SpA	12.304	0,08
497	Italgas SpA	2.941	0,02
405	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	4.843	0,03
55	Moncler SpA	3.801	0,03
279	Nexi SpA '144A'	2.186	0,01

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Italien (Fortsetzung)			
771	Piaggio & C SpA	3.196	0,02
674	Pirelli & C SpA '144A'	3.327	0,02
273	Poste Italiane SpA '144A'	2.953	0,02
110	Prysmian SpA	4.594	0,03
68	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	3.246	0,02
1.825	Saras SpA	2.261	0,02
522	Snam SpA	2.726	0,02
340	Tamburi Investment Partners SpA	3.424	0,02
17.196	Telecom Italia SpA/Milano	4.836	0,03
481	Terna - Rete Elettrica Nazionale	4.096	0,03
814	UniCredit SpA	18.885	0,12
273	Unipol Gruppo SpA	1.457	0,01
1.272	Webuild SpA	2.397	0,02
Italien insgesamt		187.542	1,24
Japan			
300	Aeon Co Ltd	6.106	0,04
400	AEON Financial Service Co Ltd	3.548	0,02
400	Aeon Mall Co Ltd	5.150	0,03
200	Air Water Inc	2.759	0,02
100	Aisin Corp	3.063	0,02
100	Ajinomoto Co Inc	3.960	0,03
200	ANA Holdings Inc	4.741	0,03
100	Asahi Group Holdings Ltd	3.857	0,03
700	Asahi Kasei Corp	4.708	0,03
100	Asics Corp	3.059	0,02
300	Astellas Pharma Inc	4.461	0,03
200	Bridgestone Corp	8.153	0,05
200	Canon Inc	5.244	0,03
200	Chubu Electric Power Co Inc	2.431	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
200	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	5.654	0,04
200	COMSYS Holdings Corp	3.936	0,03
100	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	2.719	0,02
300	Credit Saison Co Ltd	4.576	0,03
400	Daicel Corp	3.559	0,02
100	Daiichi Sankyo Co Ltd	3.148	0,02
100	Daito Trust Construction Co Ltd	10.091	0,07
200	Daiwa House Industry Co Ltd	5.247	0,03
700	Daiwa Securities Group Inc	3.585	0,02
300	DeNA Co Ltd	3.881	0,03
100	Denso Corp	6.673	0,04
100	Dentsu Group Inc	3.261	0,02
100	Dowa Holdings Co Ltd	3.145	0,02
200	Duskin Co Ltd	4.453	0,03
2.700	ENEOS Holdings Inc	9.236	0,06
300	EXEO Group Inc	5.996	0,04
100	FANUC Corp	3.482	0,02
100	Fuji Electric Co Ltd	4.352	0,03
100	FUJIFILM Holdings Corp	5.909	0,04
500	Fujikura Ltd	4.160	0,03
100	Fuyo General Lease Co Ltd	7.638	0,05
100	Hamamatsu Photonics KK	4.861	0,03
500	Hazama Ando Corp	3.719	0,02
200	Hitachi Ltd	12.310	0,08
400	Honda Motor Co Ltd	12.014	0,08
100	Horiba Ltd	5.695	0,04
100	Hoya Corp	11.814	0,08
500	Hulic Co Ltd	4.258	0,03
100	Ibiden Co Ltd	5.604	0,04
200	Idemitsu Kosan Co Ltd	3.993	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
500	INFRONEER Holdings Inc	4.687	0,03
600	Inpex Corp	6.634	0,04
300	Isuzu Motors Ltd	3.612	0,02
300	ITOCHEU Corp	11.804	0,08
200	Jaccs Co Ltd	6.946	0,05
200	Japan Airlines Co Ltd	4.317	0,03
300	Japan Post Holdings Co Ltd	2.151	0,01
200	Japan Tobacco Inc	4.363	0,03
400	JFE Holdings Inc	5.673	0,04
300	JTEKT Corp	2.709	0,02
300	Kajima Corp	4.504	0,03
300	Kansai Electric Power Co Inc/The	3.748	0,02
300	KDDI Corp	9.237	0,06
400	Kinden Corp	5.384	0,04
300	Kobe Steel Ltd	2.741	0,02
200	Koito Manufacturing Co Ltd	3.587	0,02
200	Komatsu Ltd	5.370	0,04
200	Kubota Corp	2.904	0,02
300	Kuraray Co Ltd	2.903	0,02
100	Kyocera Corp	5.390	0,04
100	Kyudenko Corp	2.671	0,02
400	Marubeni Corp	6.753	0,04
300	Marui Group Co Ltd	5.206	0,03
400	Mazda Motor Corp	3.857	0,03
300	MIRAIT ONE corp	3.758	0,03
1.100	Mitsubishi Chemical Group Corp	6.569	0,04
300	Mitsubishi Corp	14.384	0,10
400	Mitsubishi Electric Corp	5.610	0,04
400	Mitsubishi Estate Co Ltd	4.732	0,03
800	Mitsubishi HC Capital Inc	4.730	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
100	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	4.643	0,03
600	Mitsubishi Motors Corp	2.080	0,01
1.300	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	9.579	0,06
300	Mitsui & Co Ltd	11.231	0,07
200	Mitsui Chemicals Inc	5.852	0,04
100	Mitsui Fudosan Co Ltd	1.979	0,01
200	Mizuho Financial Group Inc	3.043	0,02
200	Mizuho Leasing Co Ltd	6.497	0,04
100	Murata Manufacturing Co Ltd	5.698	0,04
100	NEC Corp	4.819	0,03
400	NHK Spring Co Ltd	2.902	0,02
100	NIDEC CORP	5.428	0,04
100	Nifco Inc/Japan	2.947	0,02
100	Nintendo Co Ltd	4.526	0,03
100	Nippon Sanso Holdings Corp	2.153	0,01
500	Nippon Steel Corp	10.392	0,07
17.500	Nippon Telegraph & Telephone Corp	20.644	0,14
1.100	Nissan Motor Co Ltd	4.477	0,03
100	Niterra Co Ltd	1.995	0,01
200	NOK Corp	2.905	0,02
1.200	Nomura Holdings Inc	4.543	0,03
400	Obayashi Corp	3.443	0,02
1.600	Oji Holdings Corp	5.951	0,04
200	Olympus Corp	3.136	0,02
100	Omron Corp	6.066	0,04
200	Ono Pharmaceutical Co Ltd	3.606	0,02
200	ORIX Corp	3.615	0,02
200	Osaka Gas Co Ltd	3.055	0,02
100	Otsuka Holdings Co Ltd	3.647	0,02
200	PALTAC Corp	6.602	0,04

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
500	Panasonic Holdings Corp	6.066	0,04
600	Penta-Ocean Construction Co Ltd	3.205	0,02
200	Recruit Holdings Co Ltd	6.314	0,04
600	Renesas Electronics Corp	11.215	0,07
600	Resona Holdings Inc	2.866	0,02
200	Resonac Holdings Corp	3.219	0,02
500	Ricoh Co Ltd	4.229	0,03
100	Sankyo Co Ltd	4.027	0,03
100	SBI Holdings Inc	1.915	0,01
100	SBI Shinsei Bank Ltd	1.945	0,01
100	Secom Co Ltd	6.738	0,04
200	Sekisui Chemical Co Ltd	2.867	0,02
700	Sekisui House Ltd	14.072	0,09
200	Seven & i Holdings Co Ltd	8.586	0,06
200	SG Holdings Co Ltd	2.833	0,02
100	Shimadzu Corp	3.064	0,02
700	Shimizu Corp	4.409	0,03
400	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	13.195	0,09
100	SHO-BOND Holdings Co Ltd	3.955	0,03
400	SoftBank Corp	4.262	0,03
100	SoftBank Group Corp	4.686	0,03
200	Sony Group Corp	17.940	0,12
100	Stanley Electric Co Ltd	2.007	0,01
200	Subaru Corp	3.740	0,02
1.300	Sumitomo Chemical Co Ltd	3.926	0,03
100	Sumitomo Corp	2.104	0,01
400	Sumitomo Electric Industries Ltd	4.862	0,03
200	Sumitomo Forestry Co Ltd	4.820	0,03
100	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	3.204	0,02
100	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	4.261	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Japan (Fortsetzung)			
100	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	3.538	0,02
100	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	2.458	0,02
300	Sumitomo Rubber Industries Ltd	2.893	0,02
200	Suzuki Motor Corp	7.197	0,05
300	Taiheiyo Cement Corp	5.894	0,04
100	Taisei Corp	3.474	0,02
100	Taiyo Yuden Co Ltd	2.828	0,02
400	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	12.528	0,08
200	TDK Corp	7.703	0,05
100	Terumo Corp	3.156	0,02
800	Toda Corp	4.472	0,03
200	Tokio Marine Holdings Inc	4.587	0,03
100	Tokyo Century Corp	3.581	0,02
200	Tokyo Gas Co Ltd	4.349	0,03
700	Toray Industries Inc	3.876	0,03
100	Toshiba Corp	3.125	0,02
100	Toyo Tire Corp	1.318	0,01
200	Toyoda Gosei Co Ltd	3.767	0,03
100	Toyota Boshoku Corp	1.775	0,01
1.700	Toyota Motor Corp	27.152	0,18
100	Toyota Tsusho Corp	4.939	0,03
200	TS Tech Co Ltd	2.510	0,02
200	Tsumura & Co	3.684	0,02
100	Unicharm Corp	3.695	0,02
200	Yamaha Motor Co Ltd	5.704	0,04
300	Yamato Holdings Co Ltd	5.403	0,04
200	Yokohama Rubber Co Ltd/The	4.359	0,03
1.000	Z Holdings Corp	2.397	0,02
200	Zenkoku Hoshu Co Ltd	6.916	0,05
Japan insgesamt		854.407	5,63

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Jersey			
269	Amcors Plc	2.685	0,02
49	Aptiv Plc	5.002	0,03
103	Experian Plc	3.952	0,03
34	Ferguson Plc	5.364	0,04
1.993	IWG Plc	3.492	0,02
113	Janus Henderson Group Plc	3.079	0,02
1.378	Man Group Plc/Jersey	3.828	0,03
1.134	TP ICAP Group Plc	2.180	0,01
65	Wizz Air Holdings Plc '144A'	2.260	0,01
328	WNS Holdings Ltd ADR	24.180	0,16
741	WPP Plc	7.757	0,05
Jersey insgesamt		63.779	0,42
Kuwait			
2.429	Boubyan Bank KSCP	5.058	0,03
6.261	National Bank of Kuwait SAKP	19.047	0,13
7.951	National Industries Group Holding SAK	5.251	0,03
Kuwait insgesamt		29.356	0,19
Liberia			
29	Royal Caribbean Cruises Ltd	3.008	0,02
Liberia insgesamt		3.008	0,02
Luxemburg			
250	Allegro.eu SA '144A'	1.969	0,01
261	ArcelorMittal SA	7.099	0,05
344	B&M European Value Retail SA	2.436	0,02
175	InPost SA	1.897	0,01
261	Millicom International Cellular SA SDR	3.983	0,03
52	RTL Group SA	2.078	0,01

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Luxemburg (Fortsetzung)			
900	Samsonite International SA '144A'	2.538	0,02
46	Spotify Technology SA	7.385	0,05
381	Subsea 7 SA	4.753	0,03
562	Tenaris SA	8.409	0,05
110	Ternium SA ADR	4.362	0,03
Luxemburg insgesamt		46.909	0,31
Malaysia			
3.900	AMMB Holdings Bhd	3.025	0,02
2.400	CIMB Group Holdings Bhd	2.602	0,02
3.800	Gamuda Bhd	3.582	0,02
5.700	Hartalega Holdings Bhd	2.308	0,02
4.700	IOI Corp Bhd	3.756	0,02
800	Kuala Lumpur Kepong Bhd	3.764	0,02
1.700	Malayan Banking Bhd	3.143	0,02
900	PPB Group Bhd	3.035	0,02
2.500	Press Metal Aluminium Holdings Bhd	2.517	0,02
3.900	Public Bank Bhd	3.217	0,02
3.200	QL Resources Bhd	3.675	0,02
4.500	Yinson Holdings BHD	2.468	0,02
Malaysia insgesamt		37.092	0,24
Mauritius			
22.700	Golden Agri-Resources Ltd	4.110	0,03
844	MakeMyTrip Ltd	22.771	0,15
Mauritius insgesamt		26.881	0,18
Mexiko			
7.500	Alfa SAB de CV	4.657	0,03
9.700	America Movil SAB de CV	10.520	0,07
300	Arca Continental SAB de CV	3.078	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Mexiko (Fortsetzung)			
800	Banco del Bajío SA '144A'	2.427	0,02
2.200	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	4.556	0,03
10.000	Cemex SAB de CV	7.055	0,05
490	Coca-Cola Femsá SAB de CV (Units)	4.088	0,03
800	Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV	2.590	0,02
500	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	5.525	0,04
600	GCC SAB de CV	5.131	0,03
2.100	Gentera SAB de CV	2.247	0,01
335	Gruma SAB de CV	5.367	0,04
900	Grupo Bimbo SAB de CV	4.809	0,03
30	Grupo Elektra SAB DE CV	2.024	0,01
700	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	5.763	0,04
1.400	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV	3.319	0,02
800	Grupo Mexico SAB de CV	3.844	0,02
100	Industrias Penoles SAB de CV	1.402	0,01
1.500	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	3.330	0,02
1.100	Orbia Advance Corp SAB de CV	2.365	0,02
255	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	2.550	0,02
900	Qualitas Controladora SAB de CV	6.666	0,04
500	Regional SAB de CV	3.616	0,02
900	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	3.554	0,02
	Mexiko insgesamt	100.483	0,66
Niederlande			
90	Aalberts NV	3.783	0,02
254	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A'	3.943	0,03
757	Aegon NV	3.824	0,02
82	AerCap Holdings NV	5.209	0,03
91	Akzo Nobel NV	7.418	0,05
163	Arcadis NV	6.808	0,04

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Niederlande (Fortsetzung)			
12	Argenx SE ADR	4.677	0,03
43	ASM International NV	18.219	0,12
31	ASML Holding NV	22.423	0,15
109	ASR Nederland NV	4.904	0,03
22	BE Semiconductor Industries NV	2.383	0,02
300	CNH Industrial NV	4.322	0,03
103	Corbion NV	2.457	0,02
173	CTP NV '144A'	2.246	0,01
242	Euronext NV '144A'	16.449	0,11
24	Ferrari NV	7.842	0,05
66	Heineken Holding NV	5.735	0,04
57	Heineken NV	5.857	0,04
19	IMCD NV	2.730	0,02
1.479	ING Groep NV	19.909	0,13
356	Iveco Group NV	3.205	0,02
86	JDE Peet's NV	2.558	0,02
1.186	Koninklijke Ahold Delhaize NV	40.448	0,27
3.514	Koninklijke KPN NV	12.533	0,08
407	Koninklijke Philips NV	8.796	0,06
114	LyondellBasell Industries NV	10.469	0,07
120	NN Group NV	4.440	0,03
54	NXP Semiconductors NV	11.053	0,07
125	OCI NV	2.996	0,02
175	Prosus NV	12.813	0,08
85	Randstad NV	4.480	0,03
292	SBM Offshore NV	4.001	0,03
151	Signify NV '144A'	4.229	0,03
442	Stellantis NV	7.759	0,05
315	STMicroelectronics NV	15.659	0,10
272	Technip Energies NV	6.264	0,04

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Niederlande (Fortsetzung)			
105	TKH Group NV Dutch Cert	5.203	0,03
323	Universal Music Group NV	7.171	0,05
92	Wolters Kluwer NV	11.673	0,08
Niederlande insgesamt		326.888	2,15
Neuseeland			
927	a2 Milk Co Ltd/The	3.039	0,02
630	Auckland International Airport Ltd	3.300	0,02
615	Chorus Ltd	3.175	0,02
685	Contact Energy Ltd	3.399	0,02
235	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	3.527	0,02
777	Fletcher Building Ltd	2.580	0,02
1.806	Goodman Property Trust (Units) (REIT)	2.456	0,02
713	Infratil Ltd	4.434	0,03
82	Mainfreight Ltd	3.617	0,03
895	Meridian Energy Ltd	3.071	0,02
1.073	Spark New Zealand Ltd	3.346	0,02
Neuseeland insgesamt		35.944	0,24
Norwegen			
355	Adevinta ASA	2.333	0,02
622	DNB Bank ASA	11.652	0,08
541	Equinor ASA	15.760	0,10
90	Kongsberg Gruppen ASA	4.101	0,03
319	Mowi ASA	5.068	0,03
825	Norsk Hydro ASA	4.913	0,03
694	Orkla ASA	4.994	0,03
203	Schibsted ASA	3.567	0,02
438	SpareBank 1 SR-Bank ASA	5.319	0,04
442	Telenor ASA	4.488	0,03
Norwegen insgesamt		62.195	0,41

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Panama			
29	Copa Holdings SA	3.207	0,02
200	Intercorp Financial Services Inc	4.968	0,03
Panama insgesamt		8.175	0,05
Philippinen			
8.400	Ayala Land Inc	3.698	0,03
1.710	BDO Unibank Inc	4.266	0,03
830	International Container Terminal Services Inc	3.064	0,02
170	SM Investments Corp	2.849	0,02
11.200	SM Prime Holdings Inc	6.665	0,04
Philippinen insgesamt		20.542	0,14
Polen			
466	Alior Bank SA	5.547	0,04
281	Asseco Poland SA	5.550	0,04
2.630	Bank Millennium SA	3.729	0,02
215	Bank Polska Kasa Opieki SA	5.863	0,04
72	CD Projekt SA	2.744	0,02
21	Dino Polska SA '144A'	2.454	0,02
23	Grupa Kety SA	3.487	0,02
192	KGHM Polska Miedz SA	5.312	0,03
63	KRUK SA	6.327	0,04
33	mBank SA	3.298	0,02
2.922	Orange Polska SA	5.024	0,03
353	ORLEN SA	5.596	0,04
1.178	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	10.481	0,07
650	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	6.305	0,04
60	Santander Bank Polska SA	5.745	0,04
5.992	Tauron Polska Energia SA	4.056	0,03
Polen insgesamt		81.518	0,54

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Portugal			
302	Galp Energia SGPS SA	3.532	0,02
Portugal insgesamt		3.532	0,02
Puerto Rico			
140	EVERTEC Inc	5.156	0,03
Puerto Rico insgesamt		5.156	0,03
Katar			
5.392	Barwa Real Estate Co	3.835	0,02
5.834	Commercial Bank PSQC/The	9.294	0,06
568	Industries Qatar QSC	1.752	0,01
4.009	Masraf Al Rayan QSC	2.823	0,02
2.230	Ooredoo QPSC	6.702	0,04
8.407	Qatar Aluminum Manufacturing Co	2.933	0,02
637	Qatar Fuel QSC	2.972	0,02
2.430	Qatar Gas Transport Co Ltd	2.715	0,02
1.544	Qatar International Islamic Bank QSC	4.242	0,03
1.213	Qatar Islamic Bank SAQ	5.902	0,04
696	Qatar National Bank QPSC	2.949	0,02
Katar insgesamt		46.119	0,30
Saudi-Arabien			
99	ACWA Power Co	4.403	0,03
271	Advanced Petrochemical Co	3.186	0,02
158	Al Hammadi Holding	2.566	0,02
979	Al Rajhi Bank	19.054	0,13
67	Aldrees Petroleum and Transport Services Co	2.219	0,01
749	Alinma Bank	6.690	0,04
311	Almarai Co JSC	5.033	0,03
544	Arab National Bank	3.822	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Saudi-Arabien (Fortsetzung)			
520	Arabian Cement Co/Saudi Arabia	5.490	0,04
443	Bank AlBilad	4.571	0,03
517	Bank Al-Jazira	2.520	0,02
395	Banque Saudi Fransi	4.392	0,03
56	Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co	2.771	0,02
70	Co for Cooperative Insurance/The	2.613	0,02
45	Dallah Healthcare Co	2.013	0,01
558	Dar Al Arkan Real Estate Development Co	2.282	0,02
60	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	4.578	0,03
15	Elm Co	2.328	0,02
1.357	Emaar Economic City	3.387	0,02
300	Etihad Etisalat Co	3.831	0,03
40	Mouwasat Medical Services Co	2.581	0,02
194	Qassim Cement Co/The	3.776	0,02
6.450	Rabigh Refining & Petrochemical Co	19.776	0,13
938	Riyad Bank	8.416	0,06
145	SABIC Agri-Nutrients Co	5.010	0,03
363	Sahara International Petrochemical Co	3.567	0,02
112	Saudi Airlines Catering Co	2.950	0,02
1.092	Saudi Arabian Mining Co	12.286	0,08
662	Saudi Awwal Bank	6.734	0,04
275	Saudi Cement Co	4.355	0,03
452	Saudi Electricity Co	2.716	0,02
359	Saudi Ground Services Co	3.288	0,02
1.195	Saudi Industrial Investment Group	8.443	0,06
625	Saudi Investment Bank/The	2.843	0,02
1.020	Saudi Kayan Petrochemical Co	3.758	0,02
1.590	Saudi National Bank/The	15.600	0,10
96	Saudi Research & Media Group	4.832	0,03
36	Saudi Tadawul Group Holding Co	1.806	0,01

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Saudi-Arabien (Fortsetzung)			
856	Saudi Telecom Co	9.928	0,07
24	Saudia Dairy & Foodstuff Co	2.041	0,01
479	Savola Group/The	5.319	0,04
349	Southern Province Cement Co	4.978	0,03
424	Yamama Cement Co	4.256	0,03
324	Yanbu Cement Co	3.697	0,02
298	Yanbu National Petrochemical Co	3.770	0,02
Saudi-Arabien insgesamt		234.475	1,55
Singapur			
3.900	CapitalLand Ascendas REIT (Units) (REIT)	7.838	0,05
30.200	Capitaland India Trust (Units)	25.439	0,17
3.100	CapitalLand Integrated Commercial Trust (Units) (REIT)	4.375	0,03
500	City Developments Ltd	2.483	0,02
300	DBS Group Holdings Ltd	6.985	0,05
155	Flex Ltd	4.284	0,03
6.500	Genting Singapore Ltd	4.515	0,03
22.900	Hutchison Port Holdings Trust	4.420	0,03
200	Jardine Cycle & Carriage Ltd	5.143	0,03
1.300	Keppel Corp Ltd	6.445	0,04
3.100	Keppel DC REIT (Units) (REIT)	4.948	0,03
2.500	Mapletree Industrial Trust (Units) (REIT)	4.082	0,03
3.400	Olam Group Ltd	3.492	0,02
2.100	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	19.055	0,12
58.800	Seatrium Ltd	5.431	0,04
1.200	Sembcorp Industries Ltd	5.098	0,03
700	Singapore Airlines Ltd	3.698	0,02
400	Singapore Exchange Ltd	2.840	0,02
1.500	Singapore Technologies Engineering Ltd	4.079	0,03
2.900	Singapore Telecommunications Ltd	5.357	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Singapur (Fortsetzung)			
300	United Overseas Bank Ltd	6.207	0,04
1.500	UOL Group Ltd	7.116	0,05
500	Venture Corp Ltd	5.434	0,04
2.600	Wilmar International Ltd (Units)	7.300	0,05
3.800	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	4.212	0,03
Singapur insgesamt		160.276	1,06
Südafrika			
281	Absa Group Ltd	2.497	0,02
102	AngloGold Ashanti Ltd	2.148	0,01
390	Aspen Pharmacare Holdings Ltd	3.791	0,02
115	Bid Corp Ltd	2.516	0,02
297	Bidvest Group Ltd/The	4.113	0,03
35	Capitec Bank Holdings Ltd	2.905	0,02
1.059	FirstRand Ltd	3.840	0,03
327	Gold Fields Ltd	4.529	0,03
497	Harmony Gold Mining Co Ltd	2.085	0,01
494	Impala Platinum Holdings Ltd	3.277	0,02
152	Naspers Ltd	27.348	0,18
1.681	Omnia Holdings Ltd	5.351	0,04
294	Reinet Investments Sca Npv	6.489	0,04
1.297	Sibanye Stillwater Ltd	1.991	0,01
461	Standard Bank Group Ltd	4.333	0,03
887	Woolworths Holdings Ltd/South Africa	3.350	0,02
Südafrika insgesamt		80.563	0,53
Südkorea			
28	Celltrion Inc	3.249	0,02
13	CJ CheilJedang Corp	2.659	0,02
126	DL E&C Co Ltd	3.323	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Südkorea (Fortsetzung)			
263	Doosan Enerbility Co Ltd	3.615	0,02
9	Ecopro Co Ltd	5.150	0,03
88	GS Holdings Corp	2.448	0,02
142	Hana Financial Group Inc	4.224	0,03
113	Hankook Tire & Technology Co Ltd	2.950	0,02
470	Hanon Systems	3.264	0,02
63	Hanwha Solutions Corp	2.022	0,01
65	HD Hyundai Co Ltd	2.955	0,02
37	HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	3.271	0,02
83	HL Mando Co Ltd	3.395	0,02
124	Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	3.585	0,02
31	Hyundai Mobis Co Ltd	5.470	0,04
54	Hyundai Motor Co	8.463	0,06
127	Hyundai Steel Co	3.253	0,02
288	Industrial Bank of Korea	2.260	0,01
115	Kakao Corp	4.285	0,03
191	KB Financial Group Inc	6.922	0,05
126	Kia Corp	8.463	0,06
321	Korea Electric Power Corp	5.018	0,03
78	Korea Investment Holdings Co Ltd	3.055	0,02
7	Korea Zinc Co Ltd	2.590	0,02
256	Korean Air Lines Co Ltd	4.731	0,03
62	KT&G Corp	3.896	0,03
13	LG Chem Ltd	6.581	0,04
67	LG Electronics Inc	6.442	0,04
5	LG Energy Solution Ltd	2.098	0,01
14	LG Innotek Co Ltd	3.288	0,02
60	Meritz Financial Group Inc	1.890	0,01
764	Mirae Asset Securities Co Ltd	4.192	0,03
47	NAVER Corp	6.520	0,04

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Südkorea (Fortsetzung)			
493	NH Investment & Securities Co Ltd	3.573	0,02
12	Ottogi Corp	3.575	0,02
25	POSCO Holdings Inc	7.362	0,05
49	Samsung C&T Corp	3.931	0,03
42	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	4.606	0,03
1.461	Samsung Electronics Co Ltd	80.055	0,53
136	Samsung Engineering Co Ltd	2.921	0,02
18	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	3.142	0,02
711	Samsung Heavy Industries Co Ltd	3.599	0,02
12	Samsung SDI Co Ltd	6.093	0,04
143	Samsung Securities Co Ltd	3.907	0,03
267	Shinhan Financial Group Co Ltd	6.890	0,05
156	SK Hynix Inc	13.639	0,09
41	SK Inc	4.627	0,03
35	SK Innovation Co Ltd	4.210	0,03
328	Woori Financial Group Inc	2.935	0,02
91	Yuhan Corp	4.171	0,03
	Südkorea insgesamt	294.763	1,94
Spanien			
16	Acciona SA	2.713	0,02
565	Acerinox SA	5.994	0,04
44	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	1.544	0,01
321	Applus Services SA	3.455	0,02
2.478	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	19.011	0,12
2.743	Banco de Sabadell SA	3.154	0,02
2.712	Banco Santander SA	10.016	0,07
117	Endesa SA	2.508	0,02
796	Iberdrola SA	10.378	0,07
200	Industria de Diseno Textil SA	7.737	0,05

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Spanien (Fortsetzung)			
3.660	International Consolidated Airlines Group SA	7.533	0,05
1.483	Repsol SA	21.567	0,14
1.863	Sacyr SA	6.358	0,04
7.026	Telefonica SA	28.485	0,19
90	Viscofan SA	6.216	0,04
	Spanien insgesamt	136.669	0,90
Schweden			
234	AAK AB	4.393	0,03
196	Assa Abloy AB	4.700	0,03
327	Atlas Copco AB	4.705	0,03
452	Billerud Aktiebolag	3.430	0,02
338	Boliden AB	9.749	0,06
381	Bravida Holding AB '144A'	3.654	0,02
225	Bure Equity AB	5.220	0,03
445	Dometic Group AB '144A'	2.925	0,02
429	Elektro AB	3.310	0,02
230	Essity AB	6.113	0,04
41	Evolution AB '144A'	5.184	0,03
361	Granges AB	3.439	0,02
433	H & M Hennes & Mauritz AB	7.423	0,05
395	Hexagon AB	4.855	0,03
352	Hexpol AB	3.725	0,03
111	Holmen AB	3.981	0,03
444	Industrivarden AB	12.217	0,08
385	Investor AB	7.688	0,05
416	Kinnevik AB	5.754	0,04
166	L E Lundbergforetagen AB	7.051	0,05
151	Loomis AB - Class B	4.398	0,03
219	Nordnet AB publ	2.926	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF*

Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Schweden (Fortsetzung)			
52	Saab AB	2.808	0,02
141	Sandvik AB	2.744	0,02
310	Securitas AB	2.539	0,02
441	Skandinaviska Enskilda Banken AB	4.865	0,03
307	Skanska AB	4.296	0,03
212	SKF AB	3.682	0,02
342	Svenska Cellulosa AB SCA - Class B	4.352	0,03
592	Svenska Handelsbanken AB	4.951	0,03
292	Sweco AB	3.209	0,02
429	Swedbank AB	7.223	0,05
530	Tele2 AB	4.373	0,03
1.068	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	5.775	0,04
2.403	Telia Co AB	5.262	0,04
414	Volvo AB	8.547	0,06
493	Wihlborgs Fastigheter AB	3.560	0,02
	Schweden insgesamt	185.026	1,22
Schweiz			
394	ABB Ltd	15.493	0,10
71	Alcon Inc	5.881	0,04
2	Barry Callebaut AG	3.861	0,03
20	BKW AG	3.532	0,02
57	Cembra Money Bank AG	4.728	0,03
69	Chubb Ltd	13.287	0,09
134	Cie Financiere Richemont SA	22.714	0,15
125	Coca-Cola HBC AG	3.727	0,02
39	DSM-Firmenich AG	4.196	0,03
253	Dufry AG	11.527	0,08
4	EMS-Chemie Holding AG	3.027	0,02
82	Garmin Ltd	8.552	0,06

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Schweiz (Fortsetzung)			
6	Geberit AG	3.139	0,02
411	Holcim Ltd	27.656	0,18
66	Huber + Suhner AG	5.444	0,04
94	Julius Baer Group Ltd	5.920	0,04
64	Logitech International SA	3.809	0,02
8	Lonza Group AG	4.770	0,03
184	Nestle SA	22.130	0,15
423	Novartis AG	42.553	0,28
27	Partners Group Holding AG	25.399	0,17
141	Roche Holding AG	43.105	0,28
95	SGS SA	8.979	0,06
18	Sika AG	5.145	0,03
78	Swatch Group AG/The	22.764	0,15
5	Swisscom AG	3.117	0,02
107	TE Connectivity Ltd	14.997	0,10
341	UBS Group AG	6.897	0,05
17	Zurich Insurance Group AG	8.074	0,05
	Schweiz insgesamt	354.423	2,34
Taiwan			
2.000	ASE Technology Holding Co Ltd	7.096	0,05
4.000	Asia Cement Corp	5.702	0,04
3.000	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	3.867	0,03
4.000	China Airlines Ltd	3.365	0,02
17.000	China Development Financial Holding Corp	6.768	0,04
18.000	China Petrochemical Development Corp	5.664	0,04
4.000	China Steel Corp	3.776	0,02
1.000	Chunghwa Telecom Co Ltd	3.741	0,02
10.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	7.979	0,05
4.000	E.Sun Financial Holding Co Ltd	3.346	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Taiwan (Fortsetzung)			
3.000	Eva Airways Corp	3.834	0,02
3.000	Far Eastern New Century Corp	3.222	0,02
3.000	First Financial Holding Co Ltd	2.663	0,02
1.000	FLEXium Interconnect Inc	2.973	0,02
1.000	Formosa Plastics Corp	2.752	0,02
3.000	Foxconn Technology Co Ltd	5.356	0,04
4.000	Great Wall Enterprise Co Ltd	6.846	0,04
3.000	Highwealth Construction Corp	4.108	0,03
4.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	14.513	0,10
8.000	IBF Financial Holdings Co Ltd	3.095	0,02
8.000	Innolux Corp	3.917	0,03
2.000	Lien Hwa Industrial Holdings Corp	4.354	0,03
1.000	Lite-On Technology Corp	3.323	0,02
1.000	MediaTek Inc	22.091	0,15
2.000	Mega Financial Holding Co Ltd	2.453	0,02
1.000	Micro-Star International Co Ltd	5.667	0,04
1.000	Nan Ya Plastics Corp	2.328	0,02
1.000	Quanta Computer Inc	4.881	0,03
2.000	Synnex Technology International Corp	3.725	0,02
3.000	TA Chen Stainless Pipe	4.566	0,03
7.000	Taishin Financial Holding Co Ltd	4.248	0,03
5.000	Taiwan High Speed Rail Corp	5.161	0,03
3.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	55.483	0,37
3.000	Tatung Co Ltd	5.230	0,03
2.000	Uni-President Enterprises Corp	4.900	0,03
4.000	United Microelectronics Corp	6.229	0,04
2.000	Walsin Lihwa Corp	2.633	0,02
3.000	Wistron Corp	8.746	0,06
2.000	WPG Holdings Ltd	3.513	0,02
1.000	WT Microelectronics Co Ltd	2.183	0,01

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Taiwan (Fortsetzung)			
8.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	5.934	0,04
1.000	Yulon Finance Corp	6.374	0,04
1.000	Yulon Motor Co Ltd	2.652	0,02
Taiwan insgesamt		271.257	1,79
Thailand			
600	Advanced Info Service PCL NVDR	3.621	0,02
1.900	Airports of Thailand PCL NVDR	3.858	0,03
600	Bumrungrad Hospital PCL NVDR	3.825	0,03
7.563	Charoen Pokphand Foods PCL NVDR	4.202	0,03
2.711	Gulf Energy Development PCL NVDR	3.575	0,02
3.900	Indorama Ventures PCL NVDR	3.767	0,02
1.100	Kasikornbank PCL NVDR	4.018	0,03
3.679	Krungthai Card PCL NVDR	5.136	0,03
4.000	Minor International PCL NVDR	3.864	0,03
2.605	Muangthai Capital PCL NVDR	2.884	0,02
900	PTT Exploration & Production PCL NVDR	3.808	0,03
3.500	PTT Global Chemical PCL NVDR	3.677	0,02
5.300	PTT PCL NVDR	5.008	0,03
2.689	Srisawad Corp PCL NVDR	3.584	0,02
Thailand insgesamt		54.827	0,36
Türkei			
2.953	Akbank TAS	2.288	0,01
830	Arcelik AS	4.139	0,03
1.353	Aselsan Elektronik Sanayi Ve Ticaret AS	2.826	0,02
1.829	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	2.576	0,02
115	Ford Otomotiv Sanayi AS	3.357	0,02
765	KOC Holding AS	3.043	0,02
103	Pegasus Hava Tasimaciligi AS	2.438	0,01

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Türkei (Fortsetzung)			
4.954	Petkim Petrokimya Holding AS	2.852	0,02
829	TAV Havalimanlari Holding AS	2.969	0,02
282	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	2.731	0,02
614	Turk Hava Yollari AO	4.562	0,03
3.362	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	4.681	0,03
7.788	Turkiye Is Bankasi AS	4.200	0,03
	Türkei insgesamt	42.662	0,28
Vereinigte Arabische Emirate			
4.017	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	8.870	0,06
2.196	Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	6.361	0,04
1.867	Abu Dhabi National Oil Co for Distribution PJSC	1.982	0,01
1.893	Abu Dhabi Ports Co PJSC	3.314	0,02
2.283	ADNOC Drilling Co PJSC	2.213	0,01
12.433	Air Arabia PJSC	8.192	0,05
6.827	AL Yah Satellite Communications Co-Pjsc-Yah Sat	4.740	0,03
3.918	Aldar Properties PJSC	5.429	0,04
1.228	Alpha Dhabi Holding PJSC	6.994	0,05
4.825	Aramex PJSC	3.691	0,02
14.210	Dana Gas PJSC	3.327	0,02
6.090	Dubai Financial Market PJSC	2.487	0,02
7.194	Dubai Investments PJSC	4.564	0,03
4.739	Dubai Islamic Bank PJSC	7.057	0,05
9.147	Emaar Properties PJSC	15.963	0,11
1.624	Emirates NBD Bank PJSC	6.566	0,04
2.477	Emirates Telecommunications Group Co PJSC	15.106	0,10
3.343	First Abu Dhabi Bank PJSC	12.414	0,08
51	International Holding Co PJSC	5.471	0,04
2.992	Multiply Group PJSC	2.574	0,02
369	National Marine Dredging Co	1.961	0,01
	Vereinigte Arabische Emirate insgesamt	129.276	0,85

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich			
779	3i Group Plc	19.298	0,13
1.179	abrdn plc	3.271	0,02
2.258	Airtel Africa Plc '144A'	3.095	0,02
306	Allfunds Group Plc	1.866	0,01
395	Anglo American Plc	11.214	0,07
164	Antofagasta Plc	3.046	0,02
148	Ashtead Group Plc	10.243	0,07
198	Associated British Foods Plc	5.012	0,03
73	AstraZeneca Plc	10.465	0,07
494	Auto Trader Group Plc '144A'	3.834	0,03
1.369	Aviva Plc	6.878	0,05
867	Balfour Beatty Plc	3.757	0,02
3.776	Barclays Plc	7.363	0,05
840	Barratt Developments Plc	4.416	0,03
150	Bellway Plc	3.791	0,03
98	Berkeley Group Holdings Plc	4.888	0,03
6.634	BP Plc	38.658	0,26
783	Breedon Group Plc	3.245	0,02
489	British American Tobacco Plc	16.214	0,11
4.339	BT Group Plc	6.749	0,04
74	Bunzl Plc	2.822	0,02
160	Burberry Group Plc	4.312	0,03
4.105	Centrica Plc	6.469	0,04
45	Coca-Cola Europacific Partners Plc	2.899	0,02
127	Compass Group Plc	3.555	0,02
32	Croda International Plc	2.289	0,02
105	Diageo Plc	4.511	0,03
473	Drax Group Plc	3.488	0,02
903	DS Smith Plc	3.120	0,02
796	easyJet Plc	4.884	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)			
846	GSK Plc	14.937	0,10
114	Halma Plc	3.300	0,02
249	Hargreaves Lansdown Plc	2.582	0,02
2.501	Hays Plc	3.250	0,02
134	Hikma Pharmaceuticals Plc	3.221	0,02
382	Howden Joinery Group Plc	3.120	0,02
3.269	HSBC Holdings Plc	25.838	0,17
350	IG Group Holdings Plc	3.012	0,02
377	Imperial Brands Plc	8.333	0,06
735	Inchcape Plc	7.265	0,05
499	Informa Plc	4.606	0,03
160	Intermediate Capital Group Plc	2.802	0,02
56	Intertek Group Plc	3.037	0,02
335	Investec Plc	1.877	0,01
5.031	ITV Plc	4.369	0,03
1.284	J Sainsbury Plc	4.391	0,03
278	JET2 Plc	4.404	0,03
132	Johnson Matthey Plc	2.930	0,02
1.375	Kingfisher Plc	4.050	0,03
530	Land Securities Group Plc (REIT)	3.869	0,03
1.107	Legal & General Group Plc	3.199	0,02
289	Liberty Global Plc	5.136	0,03
13.563	Lloyds Banking Group Plc	7.516	0,05
160	London Stock Exchange Group Plc	17.018	0,11
1.824	M&G Plc	4.439	0,03
1.862	Marks & Spencer Group Plc	4.562	0,03
646	Melrose Industries Plc	4.157	0,03
2.191	Mitie Group Plc	2.685	0,02
451	Mondi Plc	6.875	0,05
859	Moneysupermarket.com Group Plc	2.957	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)			
147	Morgan Sindall Group Plc	3.420	0,02
272	National Grid Plc	3.598	0,02
1.140	NatWest Group Plc	3.490	0,02
465	Network International Holdings Plc '144A'	2.268	0,02
33	Next Plc	2.895	0,02
482	Ocado Group Plc	3.481	0,02
452	OSB Group Plc	2.758	0,02
294	Pearson Plc	3.072	0,02
411	Pennon Group Plc	3.715	0,02
218	Persimmon Plc	2.842	0,02
739	Phoenix Group Holdings Plc	4.996	0,03
353	Prudential Plc	4.975	0,03
676	QinetiQ Group Plc	3.041	0,02
92	Reckitt Benckiser Group Plc	6.915	0,05
113	RELX Plc	3.765	0,02
2.759	ReNew Energy Global Plc	15.119	0,10
470	Rentokil Initial Plc	3.675	0,02
602	Rightmove Plc	4.004	0,03
315	Rio Tinto Plc	19.966	0,13
114	Royalty Pharma Plc - Class A	3.504	0,02
592	Schroders Plc	3.291	0,02
105	Sensata Technologies Holding Plc	4.724	0,03
1.949	Serco Group Plc	3.858	0,03
142	Severn Trent Plc	4.632	0,03
2.833	Shaftesbury Capital Plc (REIT)	4.146	0,03
2.554	Shell Plc	76.062	0,50
301	Smith & Nephew Plc	4.852	0,03
77	Spectris Plc	3.519	0,02
133	SSE Plc	3.113	0,02
218	St James's Place Plc	3.014	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)			
748	Standard Chartered Plc	6.495	0,04
3.587	Taylor Wimpey Plc	4.686	0,03
442	TechnipFMC Plc	7.346	0,05
2.443	Tesco Plc	7.715	0,05
420	United Utilities Group Plc	5.135	0,03
13.111	Vodafone Group Plc	12.330	0,08
Vereinigtes Königreich insgesamt		631.806	4,16
Vereinigte Staaten			
83	3M Co	8.307	0,05
48	A O Smith Corp	3.493	0,02
241	Abbott Laboratories	26.274	0,17
415	AbbVie Inc	55.913	0,37
69	Academy Sports & Outdoors Inc	3.729	0,02
44	Acadia Healthcare Co Inc	3.504	0,02
83	Activision Blizzard Inc	6.997	0,05
23	Acuity Brands Inc	3.751	0,02
116	Adobe Inc	56.723	0,37
28	Advanced Drainage Systems Inc	3.186	0,02
32	Advanced Energy Industries Inc	3.566	0,02
179	Advanced Micro Devices Inc	20.390	0,13
85	AECOM	7.199	0,05
26	Affiliated Managers Group Inc	3.897	0,03
94	Aflac Inc	6.561	0,04
20	AGCO Corp	2.628	0,02
53	Agilent Technologies Inc	6.373	0,04
30	Air Products and Chemicals Inc	8.986	0,06
77	Airbnb Inc	9.868	0,07
33	Akamai Technologies Inc	2.966	0,02
128	Alaska Air Group Inc	6.807	0,05

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
27	Albemarle Corp	6.023	0,04
84	Alcoa Corp	2.850	0,02
20	Align Technology Inc	7.073	0,05
165	Allstate Corp/The	17.992	0,12
140	Ally Financial Inc	3.781	0,03
18	Alnylam Pharmaceuticals Inc	3.419	0,02
16	Alpha Metallurgical Resources Inc	2.630	0,02
696	Alphabet Inc	84.195	0,56
734	Alphabet Inc - Class A	87.860	0,58
481	Altria Group Inc	21.789	0,14
561	Amazon.com Inc	73.132	0,48
196	American Airlines Group Inc	3.516	0,02
125	American Express Co	21.775	0,14
38	American Financial Group Inc/OH	4.512	0,03
164	American International Group Inc	9.437	0,06
59	American States Water Co	5.133	0,03
44	American Tower Corp (REIT)	8.533	0,06
59	American Water Works Co Inc	8.422	0,06
18	Ameriprise Financial Inc	5.979	0,04
6	AmerisourceBergen Corp	1.155	0,01
56	AMETEK Inc	9.065	0,06
106	Amgen Inc	23.534	0,16
35	AMN Healthcare Services Inc	3.819	0,03
182	Amphenol Corp - Class A	15.461	0,10
50	Analog Devices Inc	9.740	0,06
16	ANSYS Inc	5.284	0,03
185	Antero Resources Corp	4.261	0,03
194	APA Corp	6.629	0,04
141	API Group Corp	3.844	0,03
50	Apollo Global Management Inc	3.841	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
15	Appfolio Inc	2.582	0,02
874	Apple Inc	169.530	1,12
199	Applied Materials Inc	28.763	0,19
19	AptarGroup Inc	2.201	0,01
76	Aramark	3.272	0,02
158	Archer-Daniels-Midland Co	11.938	0,08
38	Ares Management Corp - Class A	3.661	0,02
103	Arista Networks Inc	16.692	0,11
29	Arrow Electronics Inc	4.154	0,03
21	Arthur J Gallagher & Co	4.611	0,03
109	Artisan Partners Asset Management Inc - Class A	4.285	0,03
1.372	AT&T Inc	21.883	0,14
62	ATI Inc	2.742	0,02
40	Atkore Inc	6.238	0,04
40	Atlassian Corp	6.712	0,04
37	Atmos Energy Corp	4.305	0,03
34	Autodesk Inc	6.957	0,05
40	Autoliv Inc	3.402	0,02
80	Automatic Data Processing Inc	17.583	0,12
46	AutoNation Inc	7.572	0,05
1	AutoZone Inc	2.493	0,02
28	AvalonBay Communities Inc (REIT)	5.300	0,04
21	Avery Dennison Corp	3.608	0,02
63	Avnet Inc	3.178	0,02
27	Axcelis Technologies Inc	4.950	0,03
11	Axon Enterprise Inc	2.146	0,01
24	Badger Meter Inc	3.541	0,02
310	Baker Hughes Co - Class A	9.799	0,06
65	Ball Corp	3.784	0,03
961	Bank of America Corp	27.571	0,18

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
127	Bank of New York Mellon Corp/The	5.654	0,04
78	Baxter International Inc	3.554	0,02
43	Beacon Roofing Supply Inc	3.568	0,02
32	Becton Dickinson & Co	8.448	0,06
43	Belden Inc	4.113	0,03
55	Berry Global Group Inc	3.539	0,02
93	Best Buy Co Inc	7.621	0,05
26	BILL Holdings Inc	3.038	0,02
22	Biogen Inc	6.267	0,04
48	Black Knight Inc	2.867	0,02
32	BlackRock Inc	22.116	0,15
201	Blackstone Inc	18.687	0,12
46	Block Inc	3.062	0,02
10	Booking Holdings Inc	27.003	0,18
35	Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A	3.906	0,03
134	BorgWarner Inc	6.554	0,04
141	Boston Scientific Corp	7.627	0,05
77	Bread Financial Holdings Inc	2.417	0,02
48	Brink's Co/The	3.256	0,02
661	Bristol-Myers Squibb Co	42.271	0,28
107	Broadcom Inc	92.815	0,61
27	Broadridge Financial Solutions Inc	4.472	0,03
99	Brown & Brown Inc	6.815	0,05
47	Brown-Forman Corp	3.199	0,02
62	Builders FirstSource Inc	8.432	0,06
22	Burlington Stores Inc	3.463	0,02
44	Cabot Corp	2.943	0,02
46	Cadence Design Systems Inc	10.788	0,07
67	Caesars Entertainment Inc	3.415	0,02
93	California Water Service Group	4.802	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
58	Campbell Soup Co	2.651	0,02
116	Capital One Financial Corp	12.687	0,08
35	Cardinal Health Inc	3.310	0,02
163	Cargurus Inc	3.689	0,02
20	Carlisle Cos Inc	5.131	0,03
162	Carlyle Group Inc/The (Units)	5.176	0,03
38	CarMax Inc	3.181	0,02
145	Carrier Global Corp	7.208	0,05
32	Casella Waste Systems Inc - Class A	2.894	0,02
97	Caterpillar Inc	23.867	0,16
78	CBIZ Inc	4.156	0,03
57	Cboe Global Markets Inc	7.867	0,05
73	CBRE Group Inc - Class A	5.892	0,04
39	CDW Corp/DE	7.157	0,05
166	Centene Corp	11.197	0,07
65	CenterPoint Energy Inc	1.895	0,01
43	Ceridian HCM Holding Inc	2.880	0,02
148	CF Industries Holdings Inc	10.274	0,07
57	CH Robinson Worldwide Inc	5.378	0,04
180	ChampionX Corp	5.587	0,04
197	Charles Schwab Corp/The	11.166	0,07
4	Chemed Corp	2.167	0,01
81	Chemours Co/The	2.988	0,02
29	Cheniere Energy Inc	4.418	0,03
33	Chesapeake Energy Corp	2.761	0,02
780	Chevron Corp	122.733	0,81
4	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	8.556	0,06
23	Chord Energy Corp	3.537	0,02
45	Church & Dwight Co Inc	4.510	0,03
2.196	Churchill Capital Corp VII	22.663	0,15

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
74	Ciena Corp	3.144	0,02
115	Cigna Group/The	32.269	0,21
14	Cintas Corp	6.959	0,05
1.006	Cisco Systems Inc	52.050	0,34
265	Citigroup Inc	12.201	0,08
117	Citizens Financial Group Inc	3.051	0,02
23	Clean Harbors Inc	3.782	0,03
116	Clearway Energy Inc	3.313	0,02
314	Cleveland-Cliffs Inc	5.263	0,03
37	Clorox Co/The	5.884	0,04
38	Cloudflare Inc	2.484	0,02
38	CME Group Inc	7.041	0,05
138	CNX Resources Corp	2.445	0,02
351	Coca-Cola Co/The	21.137	0,14
105	Cognex Corp	5.882	0,04
171	Cognizant Technology Solutions Corp	11.163	0,07
198	Colgate-Palmolive Co	15.254	0,10
300	Comcast Corp	12.465	0,08
17	Comfort Systems USA Inc	2.791	0,02
62	Commercial Metals Co	3.265	0,02
115	Conagra Brands Inc	3.878	0,03
553	ConocoPhillips	57.296	0,38
22	Consolidated Edison Inc	1.989	0,01
23	Constellation Brands Inc - Class A	5.661	0,04
89	Constellation Energy Corp	8.148	0,05
8	Cooper Cos Inc/The	3.067	0,02
134	Copart Inc	12.222	0,08
240	Corning Inc	8.410	0,06
113	Corteva Inc	6.475	0,04
15	CorVel Corp	2.902	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
60	CoStar Group Inc	5.340	0,04
95	Costco Wholesale Corp	51.146	0,34
139	Coterra Energy Inc	3.517	0,02
7	Credit Acceptance Corp	3.556	0,02
37	CrowdStrike Holdings Inc	5.434	0,04
41	Crown Castle Inc (REIT)	4.672	0,03
51	Crown Holdings Inc	4.430	0,03
329	CSX Corp	11.219	0,07
17	Cummins Inc	4.168	0,03
26	Curtiss-Wright Corp	4.775	0,03
271	CVS Health Corp	18.734	0,12
83	Danaher Corp	19.920	0,13
22	Darden Restaurants Inc	3.676	0,02
49	Darling Ingredients Inc	3.126	0,02
30	DaVita Inc	3.014	0,02
10	Deckers Outdoor Corp	5.277	0,03
42	Deere & Co	17.018	0,11
137	Dell Technologies Inc	7.413	0,05
323	Delta Air Lines Inc	15.355	0,10
41	Denbury Inc	3.537	0,02
93	DENTSPLY SIRONA Inc	3.722	0,02
225	Devon Energy Corp	10.877	0,07
33	Dexcom Inc	4.241	0,03
62	Diamondback Energy Inc	8.144	0,05
25	Dick's Sporting Goods Inc	3.305	0,02
34	Diodes Inc	3.145	0,02
132	Discover Financial Services	15.424	0,10
41	Dolby Laboratories Inc - Class A	3.431	0,02
29	Dollar General Corp	4.924	0,03
28	Dollar Tree Inc	4.018	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
147	Dominion Energy Inc	7.613	0,05
204	Dow Inc	10.865	0,07
59	DR Horton Inc	7.180	0,05
107	DuPont de Nemours Inc	7.644	0,05
41	Eagle Materials Inc	7.643	0,05
54	East West Bancorp Inc	2.851	0,02
45	Eastman Chemical Co	3.767	0,02
88	eBay Inc	3.933	0,03
30	Ecolab Inc	5.601	0,04
123	Edison International	8.542	0,06
83	Edwards Lifesciences Corp	7.829	0,05
53	Electronic Arts Inc	6.874	0,05
45	Elevance Health Inc	19.993	0,13
96	Eli Lilly & Co	45.022	0,30
31	EMCOR Group Inc	5.728	0,04
81	Emerson Electric Co	7.322	0,05
42	Encompass Health Corp	2.844	0,02
17	Encore Wire Corp	3.161	0,02
159	Energizer Holdings Inc	5.339	0,04
11	Enphase Energy Inc	1.842	0,01
26	Entegris Inc	2.881	0,02
69	Entergy Corp	6.719	0,04
254	EOG Resources Inc	29.068	0,19
22	EPAM Systems Inc	4.945	0,03
188	EQT Corp	7.732	0,05
21	Equifax Inc	4.941	0,03
119	Equitable Holdings Inc	3.232	0,02
72	Equity Residential (REIT)	4.750	0,03
16	Erie Indemnity Co - Class A	3.360	0,02
30	Euronet Worldwide Inc	3.521	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
57	Evercore Inc - Class A	7.045	0,05
106	Eversource Energy	7.518	0,05
40	Exact Sciences Corp	3.756	0,02
315	Exelon Corp	12.833	0,08
22	ExlService Holdings Inc	3.323	0,02
49	Expedia Group Inc	5.360	0,04
107	Expeditors International of Washington Inc	12.961	0,09
40	Exponent Inc	3.733	0,02
36	Extra Space Storage Inc (REIT)	5.359	0,04
130	Extreme Networks Inc	3.387	0,02
1.326	Exxon Mobil Corp	142.214	0,94
34	F5 Inc	4.973	0,03
7	FactSet Research Systems Inc	2.805	0,02
3	Fair Isaac Corp	2.428	0,02
91	Fastenal Co	5.368	0,04
110	Federated Hermes Inc	3.943	0,03
45	FedEx Corp	11.156	0,07
95	Fidelity National Financial Inc	3.420	0,02
165	Fidelity National Information Services Inc	9.026	0,06
168	Fifth Third Bancorp	4.403	0,03
90	First American Financial Corp	5.132	0,03
2	First Citizens BancShares Inc/NC	2.567	0,02
23	First Solar Inc	4.372	0,03
68	FirstCash Holdings Inc	6.346	0,04
165	FirstEnergy Corp	6.415	0,04
224	Fiserv Inc	28.258	0,19
13	Five Below Inc	2.555	0,02
20	FleetCor Technologies Inc	5.022	0,03
29	Floor & Decor Holdings Inc - Class A	3.015	0,02
124	Flowers Foods Inc	3.085	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
28	FMC Corp	2.922	0,02
779	Ford Motor Co	11.786	0,08
48	Fortinet Inc	3.628	0,02
57	Fortive Corp	4.262	0,03
60	Fortune Brands Innovations Inc	4.317	0,03
132	Fox Corp	4.209	0,03
26	Fox Factory Holding Corp	2.821	0,02
128	Franklin Resources Inc	3.419	0,02
31	Freedom Holding Corp/NV	2.505	0,02
306	Freeport-McMoRan Inc	12.240	0,08
11	FTI Consulting Inc	2.092	0,01
91	Gaming and Leisure Properties Inc (REIT)	4.410	0,03
26	Gartner Inc	9.108	0,06
308	General Electric Co	33.834	0,22
89	General Mills Inc	6.826	0,05
267	General Motors Co	10.296	0,07
180	Gentex Corp	5.267	0,03
86	Genuine Parts Co	14.554	0,10
288	Gilead Sciences Inc	22.196	0,15
51	Global Payments Inc	5.025	0,03
23	Globe Life Inc	2.521	0,02
49	Goldman Sachs Group Inc/The	15.804	0,10
176	Goodyear Tire & Rubber Co/The	2.408	0,02
30	Grand Canyon Education Inc	3.096	0,02
120	Graphic Packaging Holding Co	2.884	0,02
22	Gulfport Energy Corp	2.312	0,02
64	H&E Equipment Services Inc	2.928	0,02
91	H&R Block Inc	2.900	0,02
263	Halliburton Co	8.676	0,06
50	Hamilton Lane Inc - Class A	3.999	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
77	Harley-Davidson Inc	2.711	0,02
68	Hartford Financial Services Group Inc/The	4.897	0,03
112	Hawaiian Electric Industries Inc	4.054	0,03
11	HCA Healthcare Inc	3.338	0,02
34	HealthEquity Inc	2.147	0,01
37	HEICO Corp	6.547	0,04
41	Henry Schein Inc	3.325	0,02
41	Herc Holdings Inc	5.611	0,04
25	Hershey Co/The	6.242	0,04
151	Hertz Global Holdings Inc	2.777	0,02
91	Hess Corp	12.371	0,08
284	Hewlett Packard Enterprise Co	4.771	0,03
110	HF Sinclair Corp	4.907	0,03
18	Hilton Worldwide Holdings Inc	2.620	0,02
56	Hologic Inc	4.534	0,03
43	Home Depot Inc/The	13.358	0,09
62	Hormel Foods Corp	2.494	0,02
173	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	2.912	0,02
118	Hostess Brands Inc - Class A	2.988	0,02
75	Houlihan Lokey Inc - Class A	7.373	0,05
278	Howmet Aerospace Inc	13.778	0,09
17	Hubbell Inc - Class B	5.637	0,04
15	HubSpot Inc	7.981	0,05
13	Humana Inc	5.813	0,04
335	Huntington Bancshares Inc/OH	3.611	0,02
15	IDEXX Laboratories Inc	7.533	0,05
41	Illinois Tool Works Inc	10.257	0,07
82	Incyte Corp	5.105	0,03
58	Ingersoll Rand Inc	3.791	0,03
25	Insight Enterprises Inc	3.658	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
24	Insperty Inc	2.855	0,02
11	Inspire Medical Systems Inc	3.571	0,02
10	Insulet Corp	2.883	0,02
509	Intel Corp	17.021	0,11
25	Interactive Brokers Group Inc	2.077	0,01
64	Intercontinental Exchange Inc	7.237	0,05
262	International Business Machines Corp	35.058	0,23
41	International Flavors & Fragrances Inc	3.263	0,02
106	International Paper Co	3.372	0,02
135	Interpublic Group of Cos Inc/The	5.208	0,03
15	Intuit Inc	6.873	0,05
70	Intuitive Surgical Inc	23.936	0,16
132	Invitation Homes Inc (REIT)	4.541	0,03
30	IPG Photonics Corp	4.075	0,03
41	IQVIA Holdings Inc	9.216	0,06
60	Iridium Communications Inc	3.727	0,02
62	Iron Mountain Inc (REIT)	3.523	0,02
25	J M Smucker Co/The	3.692	0,02
60	Jabil Inc	6.476	0,04
44	Jack Henry & Associates Inc	7.363	0,05
22	JB Hunt Transport Services Inc	3.983	0,03
95	Jefferies Financial Group Inc	3.151	0,02
459	JetBlue Airways Corp	4.067	0,03
344	Johnson & Johnson	56.939	0,38
25	Jones Lang LaSalle Inc	3.895	0,03
426	JPMorgan Chase & Co	61.957	0,41
178	Juniper Networks Inc	5.577	0,04
60	KBR Inc	3.904	0,03
60	Kellogg Co	4.044	0,03
85	Keurig Dr Pepper Inc	2.658	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
49	Keysight Technologies Inc	8.205	0,05
81	Kimberly-Clark Corp	11.183	0,07
282	Kimco Realty Corp (REIT)	5.561	0,04
318	Kinder Morgan Inc	5.476	0,04
11	Kinsale Capital Group Inc	4.116	0,03
95	KKR & Co Inc	5.320	0,04
45	KLA Corp	21.826	0,14
392	Kosmos Energy Ltd	2.348	0,02
151	Kraft Heinz Co/The	5.361	0,04
137	Kroger Co/The	6.439	0,04
52	Kulicke & Soffa Industries Inc	3.091	0,02
17	Laboratory Corp of America Holdings	4.103	0,03
36	Lam Research Corp	23.143	0,15
53	Lamb Weston Holdings Inc	6.092	0,04
26	Landstar System Inc	5.006	0,03
32	Las Vegas Sands Corp	1.856	0,01
48	Lattice Semiconductor Corp	4.611	0,03
23	LCI Industries	2.906	0,02
27	Lear Corp	3.876	0,03
66	Lennar Corp	8.270	0,05
45	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	3.388	0,02
24	Life Storage IncUsd0.01	3.191	0,02
10	Lithia Motors Inc - Class A	3.041	0,02
17	Littelfuse Inc	4.952	0,03
260	LKQ Corp	15.150	0,10
58	Loews Corp	3.444	0,02
69	Louisiana-Pacific Corp	5.174	0,03
27	Lowe's Cos Inc	6.094	0,04
41	LPL Financial Holdings Inc	8.915	0,06
24	Lululemon Athletica Inc	9.084	0,06

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
36	M&T Bank Corp	4.455	0,03
181	Macy's Inc	2.905	0,02
176	Magnolia Oil & Gas Corp - Class A	3.678	0,02
28	Manhattan Associates Inc	5.597	0,04
292	Marathon Oil Corp	6.722	0,04
225	Marathon Petroleum Corp	26.235	0,17
8	Markel Group Inc	11.065	0,07
26	MarketAxess Holdings Inc	6.797	0,04
81	Marriott International Inc/MD	14.879	0,10
191	Marsh & McLennan Cos Inc	35.923	0,24
16	Martin Marietta Materials Inc	7.387	0,05
84	Marvell Technology Inc	5.022	0,03
26	MasTec Inc	3.067	0,02
174	Mastercard Inc	68.434	0,45
82	Matador Resources Co	4.290	0,03
44	McCormick & Co Inc/MD	3.838	0,03
18	McDonald's Corp	5.371	0,04
36	McGrath RentCorp	3.329	0,02
10	McKesson Corp	4.273	0,03
262	MDU Resources Group Inc	5.486	0,04
15	Medpace Holdings Inc	3.603	0,02
3	MercadoLibre Inc	3.554	0,02
360	Merck & Co Inc	41.540	0,27
599	Meta Platforms Inc - Class A	171.901	1,13
80	MetLife Inc	4.522	0,03
6	Mettler-Toledo International Inc	7.870	0,05
499	MGIC Investment Corp	7.879	0,05
75	MGM Resorts International	3.294	0,02
116	Microchip Technology Inc	10.392	0,07
287	Micron Technology Inc	18.113	0,12

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
505	Microsoft Corp	171.973	1,13
34	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	5.163	0,03
43	Middlesex Water Co	3.468	0,02
184	Moderna Inc	22.356	0,15
96	Moelis & Co - Class A	4.353	0,03
25	Molina Healthcare Inc	7.531	0,05
147	Mondelez International Inc	10.722	0,07
6	MongoDB Inc - Class A	2.466	0,02
22	Monolithic Power Systems Inc	11.885	0,08
161	Monster Beverage Corp	9.248	0,06
17	Moody's Corp	5.911	0,04
205	Morgan Stanley	17.507	0,12
18	Morningstar Inc	3.529	0,02
154	Mosaic Co/The	5.390	0,04
55	Motorola Solutions Inc	16.130	0,11
84	Mr Cooper Group Inc	4.254	0,03
19	MSA Safety Inc	3.305	0,02
6	MSCI Inc - Class A	2.816	0,02
40	Mueller Industries Inc	3.491	0,02
91	Murphy Oil Corp	3.485	0,02
15	Murphy USA Inc	4.667	0,03
20	MYR Group Inc	2.767	0,02
108	Nasdaq Inc	5.384	0,04
40	National Instruments Corp	2.296	0,02
160	Navient Corp	2.973	0,02
63	NetApp Inc	4.813	0,03
111	Netflix Inc	48.894	0,32
97	NetScout Systems Inc	3.002	0,02
63	New Jersey Resources Corp	2.974	0,02
79	New York Times Co/The	3.111	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
114	Newmont Corp	4.863	0,03
201	News Corp	3.920	0,03
20	Nexstar Media Group Inc - Class A	3.331	0,02
395	NextEra Energy Inc	29.309	0,19
107	NIKE Inc	11.810	0,08
160	NMI Holdings Inc - Class A	4.131	0,03
33	Norfolk Southern Corp	7.483	0,05
49	Northern Trust Corp	3.633	0,02
196	NOV Inc	3.144	0,02
215	NRG Energy Inc	8.039	0,05
135	Nucor Corp	22.137	0,15
263	NVIDIA Corp	111.254	0,73
2	NVR Inc	12.701	0,08
436	Occidental Petroleum Corp	25.637	0,17
44	Old Dominion Freight Line Inc	16.269	0,11
102	Old Republic International Corp	2.567	0,02
102	Olin Corp	5.242	0,03
56	Omnicom Group Inc	5.328	0,04
129	ON Semiconductor Corp	12.201	0,08
38	ONE Gas Inc	2.919	0,02
95	OneMain Holdings Inc	4.151	0,03
184	ONEOK Inc	11.356	0,07
46	Onto Innovation Inc	5.358	0,04
83	Oracle Corp	9.884	0,07
2	O'Reilly Automotive Inc	1.911	0,01
191	Ovintiv Inc	7.271	0,05
37	Owens Corning	4.829	0,03
79	PACCAR Inc	6.608	0,04
24	Packaging Corp of America	3.172	0,02
39	Palo Alto Networks Inc	9.965	0,07

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
17	Parker-Hannifin Corp	6.631	0,04
89	Paychex Inc	9.956	0,07
23	Paycom Software Inc	7.389	0,05
124	PayPal Holdings Inc	8.275	0,05
114	PBF Energy Inc - Class A	4.667	0,03
65	PDC Energy Inc	4.624	0,03
185	PepsiCo Inc	34.266	0,23
66	Performance Food Group Co	3.976	0,03
1.452	Pfizer Inc	53.259	0,35
45	Philip Morris International Inc	4.393	0,03
197	Phillips 66	18.790	0,12
319	Pinterest Inc	8.721	0,06
88	Pioneer Natural Resources Co	18.232	0,12
37	PJT Partners Inc	2.577	0,02
66	PNC Financial Services Group Inc/The	8.313	0,05
31	Polaris Inc	3.749	0,02
16	Pool Corp	5.994	0,04
39	Post Holdings Inc	3.379	0,02
91	PotlatchDeltic Corp (REIT)	4.809	0,03
41	Power Integrations Inc	3.881	0,03
44	PPG Industries Inc	6.525	0,04
62	Prestige Consumer Healthcare Inc	3.685	0,02
28	Primerica Inc	5.537	0,04
46	Principal Financial Group Inc	3.489	0,02
312	Procter & Gamble Co/The	47.343	0,31
60	Progressive Corp/The	7.942	0,05
72	Prologis Inc (REIT)	8.829	0,06
55	Prudential Financial Inc	4.852	0,03
27	PTC Inc	3.842	0,03
36	Public Service Enterprise Group Inc	2.254	0,01

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
36	Public Storage (REIT)	10.508	0,07
76	PulteGroup Inc	5.904	0,04
111	Pure Storage Inc	4.087	0,03
33	Qorvo Inc	3.367	0,02
394	QUALCOMM Inc	46.902	0,31
27	Qualys Inc	3.488	0,02
29	Quanta Services Inc	5.697	0,04
25	Quest Diagnostics Inc	3.514	0,02
263	Radian Group Inc	6.649	0,04
87	Rambus Inc	5.583	0,04
181	Range Resources Corp	5.321	0,04
40	Raymond James Financial Inc	4.151	0,03
74	Realty Income Corp (REIT)	4.424	0,03
58	Red Rock Resorts Inc	2.713	0,02
21	Regal Rexnord Corp	3.232	0,02
19	Regeneron Pharmaceuticals Inc	13.652	0,09
223	Regions Financial Corp	3.974	0,03
19	Reinsurance Group of America Inc	2.635	0,02
36	Reliance Steel & Aluminum Co	9.777	0,06
37	Republic Services Inc - Class A	5.667	0,04
20	ResMed Inc	4.370	0,03
86	Rexford Industrial Realty Inc (REIT)	4.491	0,03
88	Robert Half Inc	6.619	0,04
22	Rockwell Automation Inc	7.248	0,05
55	Rollins Inc	2.356	0,02
13	Roper Technologies Inc	6.250	0,04
85	Ross Stores Inc	9.531	0,06
39	RPM International Inc	3.499	0,02
19	S&P Global Inc	7.617	0,05
9	Saia Inc	3.082	0,02

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
95	Salesforce Inc	20.070	0,13
19	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	4.403	0,03
33	Science Applications International Corp	3.712	0,02
17	Seagen Inc	3.272	0,02
80	Sealed Air Corp	3.200	0,02
122	SEI Investments Co	7.274	0,05
36	Sempra	5.241	0,03
22	ServiceNow Inc	12.363	0,08
43	Sherwin-Williams Co/The	11.417	0,08
7	Shockwave Medical Inc	1.998	0,01
47	Simon Property Group Inc (REIT)	5.428	0,04
53	SJW Group	3.716	0,02
50	Skechers USA Inc	2.633	0,02
44	Skyline Champion Corp	2.880	0,02
38	Skyworks Solutions Inc	4.206	0,03
208	SLM Corp	3.395	0,02
95	SM Energy Co	3.005	0,02
128	Southern Copper Corp	9.183	0,06
220	Southwest Airlines Co	7.966	0,05
683	Southwestern Energy Co	4.105	0,03
25	Splunk Inc	2.652	0,02
20	SPS Commerce Inc	3.841	0,03
96	SS&C Technologies Holdings Inc	5.818	0,04
55	Starbucks Corp	5.448	0,04
68	State Street Corp	4.976	0,03
116	Steel Dynamics Inc	12.636	0,08
53	Stifel Financial Corp	3.163	0,02
35	Stryker Corp	10.678	0,07
109	Summit Materials Inc - Class A	4.126	0,03
33	Sun Communities Inc (REIT)	4.305	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
11	Super Micro Computer Inc	2.742	0,02
52	Sylvamo Corp	2.103	0,01
194	Synchrony Financial	6.580	0,04
43	Synopsys Inc	18.723	0,12
164	Sysco Corp	12.169	0,08
192	T Rowe Price Group Inc	21.508	0,14
30	Take-Two Interactive Software Inc	4.415	0,03
168	Tapestry Inc	7.190	0,05
143	Targa Resources Corp	10.882	0,07
101	Target Corp	13.322	0,09
63	Taylor Morrison Home Corp - Class A	3.073	0,02
35	TD SYNEX Corp	3.290	0,02
164	Teladoc Health Inc	4.152	0,03
14	Teledyne Technologies Inc	5.756	0,04
82	Tempur Sealy International Inc	3.286	0,02
64	Tenet Healthcare Corp	5.208	0,03
73	Teradyne Inc	8.127	0,05
160	Tesla Inc	41.883	0,28
20	Tetra Tech Inc	3.275	0,02
171	Texas Instruments Inc	30.783	0,20
5	Texas Pacific Land Corp	6.583	0,04
30	Texas Roadhouse Inc - Class A	3.368	0,02
39	Thermo Fisher Scientific Inc	20.348	0,13
42	Thor Industries Inc	4.347	0,03
274	TJX Cos Inc/The	23.232	0,15
111	T-Mobile US Inc	15.418	0,10
51	Toll Brothers Inc	4.033	0,03
15	TopBuild Corp	3.990	0,03
17	Tractor Supply Co	3.759	0,02
87	Trade Desk Inc/The - Class A	6.718	0,04

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
72	Tradeweb Markets Inc - Class A	4.931	0,03
6	TransDigm Group Inc	5.365	0,04
46	TransUnion	3.603	0,02
41	Travelers Cos Inc/The	7.120	0,05
94	Trimble Inc	4.976	0,03
24	TriNet Group Inc	2.279	0,02
249	Truist Financial Corp	7.557	0,05
33	Twilio Inc - Class A	2.099	0,01
8	Tyler Technologies Inc	3.332	0,02
87	Tyson Foods Inc - Class A	4.440	0,03
718	Uber Technologies Inc	30.996	0,20
45	UFP Industries Inc	4.367	0,03
116	UGI Corp	3.129	0,02
17	Ulta Beauty Inc	8.000	0,05
93	Union Pacific Corp	19.030	0,13
144	United Airlines Holdings Inc	7.901	0,05
125	United Parcel Service Inc - Class B	22.406	0,15
75	United Rentals Inc	33.403	0,22
101	United States Steel Corp	2.526	0,02
17	United Therapeutics Corp	3.753	0,02
143	UnitedHealth Group Inc	68.732	0,45
54	Univar Solutions Inc	1.935	0,01
24	Universal Display Corp	3.459	0,02
18	Universal Health Services Inc	2.840	0,02
89	Unum Group	4.245	0,03
218	US Bancorp	7.203	0,05
99	US Foods Holding Corp	4.356	0,03
199	Valero Energy Corp	23.343	0,15
16	Valmont Industries Inc	4.657	0,03
52	Veeva Systems Inc - Class A	10.282	0,07

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
308	Veradigm Inc	3.881	0,03
30	Verisk Analytics Inc - Class A	6.781	0,04
738	Verizon Communications Inc	27.446	0,18
132	Verra Mobility Corp - Class A	2.603	0,02
72	Vertex Pharmaceuticals Inc	25.338	0,17
423	Viatis Inc	4.222	0,03
394	Viavi Solutions Inc	4.464	0,03
181	VICI Properties Inc (REIT) - Class A	5.689	0,04
156	Viper Energy Partners LP (Units)	4.185	0,03
246	Visa Inc - Class A	58.420	0,39
141	Vishay Intertechnology Inc	4.145	0,03
20	Visteon Corp	2.872	0,02
15	VMware Inc	2.155	0,01
114	Vontier Corp	3.672	0,02
51	Voya Financial Inc	3.657	0,02
37	Vulcan Materials Co	8.341	0,06
90	W R Berkley Corp	5.360	0,04
208	Walmart Inc	32.693	0,22
211	Walt Disney Co/The	18.838	0,12
305	Warner Bros Discovery Inc	3.825	0,03
74	Waste Management Inc	12.833	0,08
19	Waters Corp	5.064	0,03
11	Watsco Inc	4.196	0,03
53	Welltower Inc (REIT)	4.287	0,03
30	WESCO International Inc	5.372	0,04
16	West Pharmaceutical Services Inc	6.120	0,04
102	Western Digital Corp	3.869	0,03
241	Western Union Co/The	2.827	0,02
22	WEX Inc	4.006	0,03
28	Whirlpool Corp	4.166	0,03

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien (Fortsetzung)			
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)			
225	Williams Cos Inc/The	7.342	0,05
40	Williams-Sonoma Inc	5.006	0,03
188	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	8.985	0,06
23	Workday Inc - Class A	5.195	0,03
9	WW Grainger Inc	7.097	0,05
73	XPO Inc	4.307	0,03
31	Xylem Inc/NY	3.491	0,02
124	Yelp Inc - Class A	4.515	0,03
78	Yum China Holdings Inc	4.407	0,03
9	Yum! Brands Inc	1.247	0,01
15	Zebra Technologies Corp	4.437	0,03
61	Ziff Davis Inc	4.274	0,03
78	Zillow Group Inc - Class A	3.838	0,03
35	Zimmer Biomet Holdings Inc	5.096	0,03
65	Zoetis Inc	11.194	0,07
Vereinigte Staaten insgesamt		6.711.853	44,25
Stammaktien insgesamt		15.046.915	99,19
Vorzugsaktien			
Brasilien			
2.700	Banco Bradesco SA - Preference	9.207	0,06
1.900	Cia Energetica de Minas Gerais - Preference	5.065	0,03
3.100	Gerdau SA - Preference	16.110	0,11
2.000	Itau Unibanco Holding SA - Preference	11.783	0,08
1.800	Itausa SA - Preference	3.597	0,02
2.700	Metalurgica Gerdau SA - Preference	6.616	0,04
1.900	Petroleo Brasileiro SA - Preference	11.631	0,08
1.900	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais S/A Usiminas - Preference	2.784	0,02
Brasilien insgesamt		66.793	0,44

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Vorzugsaktien			
Kolumbien			
606	Bancolombia SA - Preference	4.062	0,03
Kolumbien insgesamt		4.062	0,03
Deutschland			
39	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	4.434	0,03
94	Henkel AG & Co KGaA - Preference	7.513	0,05
129	Porsche Automobil Holding SE - Preference	7.763	0,05
114	Volkswagen AG - Preference	15.291	0,10
Deutschland insgesamt		35.001	0,23
Südkorea			
23	Hyundai Motor Co - Preference	1.899	0,01
242	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	10.928	0,07
Südkorea insgesamt		12.827	0,08
Vorzugsaktien Insgesamt		118.683	0,78
Bezugsrechte			
Spanien			
1.863	Sacyr S.A. Rights 07/07/2023	167	–
Spanien insgesamt		167	–
Bezugsrechte insgesamt		167	–
Gesamtanlagen			
Stammaktien		15.046.915	99,19
Vorzugsaktien		118.683	0,78
Bezugsrechte		167	–
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		3.584	0,03
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		15.169.349	100,00

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2023

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	97,59
Sonstige Vermögenswerte	2,41
	100,00
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

OGAW-V-Vergütungspolitik (ungeprüft)

Angaben zur Vergütung

Gemäß der Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW), oftmals als OGAW-V-Richtlinie bezeichnet, ist Legal and General UCITS ETF Plc als OGAW dazu verpflichtet, den Gesamtbetrag der von der Verwaltungsgesellschaft des OGAW und vom OGAW an identifizierte Mitarbeiter gezahlten Vergütungen für das Jahr, aufgeteilt in feste und variable Vergütungen, die Anzahl der Begünstigten und gegebenenfalls die vom OGAW gezahlten übertragenen Zinsen offenzulegen.

Die nachstehende Tabelle gibt einen Überblick über Folgendes:

- Gesamtbetrag der von der Verwaltungsgesellschaft des OGAW an alle Mitarbeiter des OGAW gezahlten Vergütung; und
- die Gesamtvergütung, welche die Verwaltungsgesellschaft des OGAW an die Mitarbeiter des OGAW-Vergütungskodex gezahlt hat.

	Mitarbeiterzahl	Feste Vergütung (Tsd. GBP)	Variable Vergütung (Tsd. GBP)	Vergütung im Zusammenhang mit diesem Fonds (anteilig) (Tsd. GBP)
Kontrollfunktionen	54	12.681	16.005	2.436
Wesentliche Risikoträger	61	6.283	4.317	238

Kontrollfunktionen

Zum 31. Dezember 2022 hatte die Verwaltungsgesellschaft der OGAWs fünf Mitarbeiter von Legal & General Investment Management (Holdings) Limited (LGIMH) sowie einen Mitarbeiter von Legal & General Resources Limited (LGR) als Verwaltungsratsmitglieder eingesetzt. Darüber hinaus gab es drei weitere nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder. Die Verwaltungsgesellschaft der OGAWs beauftragte außerdem weitere 45 Mitarbeiter von LGIMH und LGR mit der Übernahme einer Reihe von Kontrollfunktionen, darunter: Chief Compliance Officer, Money Laundering Reporting Officer (Geldwäschebeauftragter), Client Asset Oversight (Aufsicht über Kundenvermögen), Systems and Controls Functions (System- und Kontrollfunktionen) sowie wichtige Managementfunktionen. Diese Mitarbeiter führten außerdem Tätigkeiten für andere Unternehmen der L&G-Gruppe aus. Die Gesamtvergütung für die Dienste dieser Personen innerhalb der L&G-Gruppe ist in der obigen Tabelle aufgeführt. Wir haben die Vergütungswerte anteilig berechnet, indem wir den Nettoinventarwert der OGAW-Anlagen durch einen Prozentsatz des gesamten von der Verwaltungsgesellschaft verwalteten Vermögens dividiert haben.

Wesentliche Risikoträger

Zum 31. Dezember 2022 nutzte die Verwaltungsgesellschaft der OGAWs das Index Investment Team von Legal & General Investment Management, das aus 90 Anlageexperten in unserer Londoner Niederlassung besteht. Das Team besteht aus einer Reihe von Fondsmanagern, Analysten und Mitarbeitern für Unterstützungsdienste, wobei die Fondsmanager befugt sind, im Namen des Fonds diskretionäre Anlageverwaltungsentscheidungen zu treffen. Das Team ist zudem mit dem Management anderer Fonds/Kapitalanlagen von Legal & General betraut und wird auch von anderen Unternehmen der L&G-Gruppe genutzt. Die Gesamtvergütung, die die Mitglieder des Teams für alle ihre Dienstleistungen innerhalb der L&G-Gruppe erhalten, ist in der obigen Tabelle dargelegt. Wir haben die Vergütungswerte anteilig berechnet, indem wir den Nettoinventarwert der OGAW-Anlagen durch einen Prozentsatz der von den jeweiligen Teams verwalteten Gesamtvermögenswerten dividiert haben.

Die Angaben zur Vergütungen in diesem Jahresbericht und dem geprüften Abschluss erfolgen freiwillig und im Interesse der Transparenz. Sie stellen keine formelle Offenlegung der Vergütungen gemäß irgendeiner Verordnung dar. Wünschen Sie die Offenlegung der Solvency-II-Vergütung für die Legal & General Group Plc für alle ihre Mitarbeiter einzusehen, so beziehen Sie die diesbezüglichen Informationen bitte aus den Jahresberichten und Abschlüssen der Unternehmensgruppe, die Sie hier finden können: <https://www.legalandgeneralgroup.com/investors/>

Value-at-Risk-Bericht („VaR“-Bericht) (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Fonds	Tracking-Index	Tatsächlicher Wert	Max. Wert	Wertüberprüfung
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return	1,00	2	Erfüllt
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR	1,01	2	Erfüllt
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	Barclays Backwardation Tilt Multi-Strategy Capped Total Return Index	1,00	2	Erfüllt

Der relative VaR ist im Grunde der VaR des NIW je Anteil des Fonds, dividiert durch den VaR seines nicht gehebelten Referenzindex. Der VaR des NIW je Anteil des Fonds darf das Zweifache des VaR des nicht gehebelten Referenzindex nicht übersteigen. Ein VaR von mehr als 2 wird als „nicht erfüllt“ angesehen und an die jeweils zuständige Behörde gemeldet. Da die Short-Inverse-Indizes und die Long-Leveraged-Indizes den -2-fachen bzw. den +2-fachen VaR des nicht gehebelten Referenzindex anwenden, zielen die Fonds effektiv auf den Grenzwert von 2 ab. Zuvor wurde der Wert auf 2 Dezimalstellen berichtet, wenn kein Verstoß vorlag; derzeit geben wir 4 Dezimalstellen an, wenn ein technischer Verstoß vorliegt. Deshalb beabsichtigen wir eine Reduzierung des gehebelten Swap-Engagements auf ca. xx,xx % bis xx,xx %. Dadurch wird der relative VaR im Zeitablauf knapp unter 2 gebracht, wenn die Daten für ein Jahr herangezogen werden. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 kam es zu keinen Verstößen.

Weitere Informationen (ungeprüft)

Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions)

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 wurden von den Anlageverwaltern im Namen der Gesellschaft keine Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen abgeschlossen.

Wechselkurse

Zur Umrechnung der auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten per 30. Juni 2023 und per 30. Juni 2022 in US-Dollar wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Australischer Dollar	1,5023	1,4542
Brasilianischer Real	4,8240	5,2294
Kanadischer Dollar	1,3232	1,2900
Chilenischer Peso	802,1500	936,8651
Chinesischer Yuan	7,2748	6,7042
Chinesischer Yuan Renminbi	7,2641	6,6943
Kolumbianischer Peso	4.175,7781	4.161,1019
Tschechische Krone	21,7768	23,6601
Dänische Krone	6,8249	7,1133
Ägyptisches Pfund	30,9000	18,8000
Euro	0,9166	0,9565
Hongkong Dollar	7,8366	7,8470
Ungarischer Forint	341,8882	379,5400
Indische Rupie	82,0363	78,9725
Indonesische Rupiah	14.992,5005	14.897,5005
Israelischer Schekel	3,7109	3,5022
Japanischer Yen	144,5350	135,8550
Koreanischer Won	1.317,6500	1.298,4001
Kuwaitischer Dinar	0,3074	0,3069
Malaysischer Ringgit	4,6675	4,4075
Mexikanischer Peso	17,1505	20,1757
Neuseeland-Dollar	1,6322	1,6084
Norwegische Krone	10,7136	9,8797
Pakistanische Rupie	286,5501	204,6250
Philippinischer Peso	55,1995	54,9850
Polnischer Zloty	4,0629	4,4958
Britisches Pfund	0,7866	0,8234
Katar-Riyal	3,6400	3,6417
Rumänischer Leu	4,5456	n. zutr.
Russischer Rubel	89,5000	54,7501
Saudi Riyal	3,7507	3,7521
Singapur-Dollar	1,3534	1,3917
Südafrikanischer Rand	18,8913	16,3825
Schwedische Krone	10,8014	10,2474

Zusätzliche Informationen (ungeprüft) (Fortsetzung)

Wechselkurse (Fortsetzung)

	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Schweizer Franken	0,8946	0,9573
Taiwanesischer Dollar	31,1445	29,7335
Thailändischer Baht	35,4550	35,3550
Türkische Lira	26,0700	16,6965
VAE-Dirham	3,6730	3,6731

Zur Umrechnung der auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten per 30. Juni 2023 und per 30. Juni 2022 in Euro wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Australischer Dollar	1,6390	1,5203
Dänische Krone	7,4460	7,4367
Hongkong Dollar	8,5498	8,2036
Norwegische Krone	11,6886	10,3288
Polnischer Zloty	4,4327	4,7002
Britisches Pfund	0,8581	0,8608
Schwedische Krone	11,7843	10,7132
Schweizer Franken	0,9761	1,0009
US-Dollar	1,0910	1,0455

Zur Umrechnung der auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten per 30. Juni 2023 und per 30. Juni 2022 in GBP wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Euro	1,1653	1,1617
Norwegische Krone	13,6207	n. zutr.
US-Dollar	1,2714	1,2145

Zur Umrechnung der Erträge und Aufwendungen aus Fremdwährungen zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 wurden die folgenden durchschnittlichen Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2023	30. Juni 2023	30. Juni 2023
	US\$	EUR	GBP
Euro	0,9563	1,0000	1,1498
Britisches Pfund	0,8315	0,8697	1,0000
US-Dollar	1,0000	1,0457	1,2026

	30. Juni 2022	30. Juni 2022	30. Juni 2022
	US\$	EUR	GBP
Euro	0,8881	1,0000	1,1805
Britisches Pfund	0,7523	0,8471	1,0000
US-Dollar	1,0000	1,1259	1,3292

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft)

I. Allgemeine Daten

„Wertpapier- oder Warenleihgeschäfte“ sind in Artikel 3(7) der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung (die „Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften“) definiert. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 hat die Gesellschaft keine Wertpapier- oder Warenleihgeschäfte für einen ihrer Fonds getätigt.

„Wertpapierfinanzierungsgeschäft“ oder „WFG“ ist in Artikel 3(11) der Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften definiert. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 waren die einzigen WFG, in die die Gesellschaft anlegte, umgekehrte Pensionsgeschäfte, die sie nur in Bezug auf die Fonds mit synthetischer Nachbildung einging.

„Total Return Swap“ ist in Artikel 3(18) der Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften definiert. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 ging die Gesellschaft nur in Bezug auf die Fonds mit synthetischer Nachbildung Total Return Swaps (in diesem Jahresabschluss als „OTC-Swaps“ definiert) ein.

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 erzielten die Fonds mit synthetischer Nachbildung Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften. Diese Erträge wurden vollständig an die jeweiligen Fonds mit synthetischer Nachbildung überwiesen und werden in der Gesamtergebnisrechnung beginnend auf Seite 69 ausgewiesen.

II. Konzentrationsdaten

In den nachstehenden Tabellen sind die zehn größten Emittenten nach dem Wert der von den einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung per 30. Juni 2023 im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) Sachsicherheiten aufgeführt:

Sicherheitenemittent	Marktwert der Sicherheiten	Sicherheitenemittent	Marktwert der Sicherheiten
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	\$	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	\$
Procter & Gamble Co/The	21.321.138	Johnson & Johnson	77.205.646
Johnson & Johnson	21.321.127	Covestro AG	77.205.619
Progressive Corp/The	21.321.100	NVIDIA Corp	77.205.381
Eiffage SA	21.321.060	RWE AG	76.225.195
Amgen Inc	21.321.024	Comcast Corp	61.668.925
RWE AG	21.320.983	Amazon.com Inc	55.049.724
Meta Platforms Inc	21.320.893	Eli Lilly & Co	54.399.336
Goldman Sachs Group Inc/The	21.320.862	AbbVie Inc	50.261.432
ResMed Inc	18.266.819	Merck KGaA	49.063.153
Bayerische Motoren Werke AG	16.718.351	Walmart Inc	47.547.108
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	\$	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	\$
Australischer Dollar	148.694	Netherlands Government Bond	6.177.867
Euro	109.726.890	Republic of Austria Government Bond	6.158.771
Japanischer Yen	17.401.351	Kingdom of Belgium Government Bond	5.563.101
Neuseeland-Dollar	3.691	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	5.555.118
Norwegische Krone	25.891.296	French Republic Government Bond OAT	5.197.176
Britisches Pfund	36.203.205	Canadian Government Bond	1.220.217
Schwedische Krone	6.867.614	Bundesschatzanweisungen	482.630
Schweizer Franken	326.100	United Kingdom Treasury Bill	189.592
US-Dollar	256.847.637	United States Treasury Note/Bond	47.912
	453.416.478		

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

Die nachstehenden Tabellen liefern eine Währungsanalyse der von den einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung per 30. Juni 2023 im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) Sachsicherheiten:

Währung		Währung	
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	\$	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	\$
Australischer Dollar	330.986	Kanadischer Dollar	1.220.217
Kanadischer Dollar	9.159	Euro	29.134.663
Dänische Krone	48.166.463	Britisches Pfund	189.592
Euro	408.250.554	US-Dollar	47.912
Japanischer Yen	47.089.497		30.592.384
Neuseeland-Dollar	99.862		
Norwegische Krone	53.505.198		
Britisches Pfund	259.767.981		
Schwedische Krone	6.867.614		
Schweizer Franken	840.410		
US-Dollar	810.651.270		
	1.635.578.994		

Nähere Angaben zu für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltenen Sicherheiten und Barsicherheiten, die von/bei Swap-Kontrahenten hinterlegt wurden, finden Sie in Anmerkung 5 („Sicherheiten“).

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

In der nachstehenden Tabelle ist für die einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung der Zeitwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte und OTC-Swaps je Kontrahent per 30. Juni 2023 aufgeführt:

Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Kontrahenten	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	\$	\$	\$
Merrill Lynch International	–	30.889.828	–
Barclays Bank Plc	426.422.859	–	1.544.114.955
	426.422.859	30.889.828	1.544.114.955

Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Kontrahenten	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G Multi- Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF ¹
	Marktwert der ent- gegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der ent- gegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der ent- gegengenommenen Sicherheiten
	\$	\$	\$
Merrill Lynch International	–	30.592.384	–
Barclays Bank Plc	453.416.478	–	1.635.578.994
	453.416.478	30.592.384	1.635.578.994

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

OTC-Swaps – Kontrahenten	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF
	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
	\$	\$	\$
Merrill Lynch International	–	192.143	–
Barclays Bank Plc	(9.243.839)	–	(53.399.628)
	(9.243.839)	192.143	(53.399.628)

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

III. Transaktionsdaten

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der entgegengenommenen Sicherheiten für die umgekehrten Pensionsgeschäfte per 30. Juni 2023:

Fälligkeitsprofil	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten
	\$	\$	\$
Weniger als ein Tag	–	–	–
Ein Tag bis eine Woche	–	–	–
Eine Woche bis ein Monat	–	–	–
Ein bis drei Monate	–	189.592	–
Drei Monate bis ein Jahr	–	–	–
Mehr als ein Jahr	–	30.402.792	–
Offene Fälligkeit	453.416.478	–	1.635.578.994
	453.416.478	30.592.384	1.635.578.994

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Fälligkeitsprofil	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF Zeitwert	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF Zeitwert	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF Zeitwert
	\$	\$	\$
Weniger als ein Tag	–	–	–
Ein Tag bis eine Woche	–	–	–
Eine Woche bis ein Monat	426.422.859	30.889.828	1.544.114.955
Ein bis drei Monate	–	–	–
Drei Monate bis ein Jahr	–	–	–
Mehr als ein Jahr	–	–	–
Offene Fälligkeit	–	–	–
	426.422.859	30.889.828	1.544.114.955

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

III. Transaktionsdaten (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der OTC-Swap-Transaktionen zum 30. Juni 2023:

Marktwerte - OTC-Swap-Transaktionen	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF
	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
	\$	\$	\$
Weniger als ein Tag	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	-	-	-
Eine Woche bis ein Monat	(9.243.839)	192.143	(53.399.628)
Ein bis drei Monate	-	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-	-
Offene Fälligkeit	-	-	-
	(9.243.839)	192.143	(53.399.628)

Einzelheiten zur Abrechnung, zum Clearing und zur sicheren Verwahrung der von den einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) und gestellten Sicherheiten entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „3.C.(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“ in Anmerkung 12 in diesem Jahresabschluss.

Einzelheiten zur Wiederverwendung von Sicherheiten entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „3.C.(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“ in Anmerkung 12 in diesem Jahresabschluss.

Die drei Kontrahenten der Gesellschaft für umgekehrte Pensionsgeschäfte und OTC-Swaps sind Barclays Bank Plc, Citigroup Global Markets Limited und Merrill Lynch International („Repo-Kontrahenten“). Das Niederlassungsland jedes Kontrahenten ist das Vereinigte Königreich.

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

III. Transaktionsdaten (Fortsetzung)

Zulässigkeit von Sicherheiten

OTC-Swaps: Es sind nur Barmittel (in der Basiswährung des betreffenden Fonds) als Sicherheiten im Rahmen von „unfunded“ Swaps zulässig.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte:

Alle als Sicherheiten von den Repo-Kontrahenten für die einzelnen Fonds erhaltenen Wertpapiere erfüllen die von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank vorgeschriebenen allgemeine Bestimmungen und Kriterien. Alle auf den Fonds übertragenen Sicherheiten erfüllen die Anforderungen der „Leitlinien zu börsengehandelten Indexfonds (Exchange Traded Funds, ETFs) und anderen OGAW-Themen“ der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde („ESMA“). Die als Sicherheiten an einen Fonds übertragenen Wertpapiere müssen bestimmte Eignungskriterien erfüllen, u. a., dass es sich entweder um Aktienwerte oder festverzinsliche staatliche und/oder supranationale Wertpapiere handeln muss. Es besteht eine Dreiparteien-Vereinbarung zur Sicherheitenverwaltung („Aufstellung der zulässigen Sicherheiten“), derzufolge die Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds), der Repo-Kontrahent und der Sicherheitenverwalter (der ein Beauftragter der Verwahrstelle ist) bestimmte Kriterien vereinbart haben, die eingehalten werden müssen, damit eine Sicherheit zur Übertragung zwischen den Parteien „zulässig“ ist. Eine diesbezügliche Zusammenfassung folgt nachstehend für Aktien bzw. festverzinsliche Wertpapiere. Dadurch ist sichergestellt, dass nur Sicherheiten, die die von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank vorgeschriebenen Zulassungskriterien erfüllen (und von den Beteiligten im Rahmen der Aufstellung der zulässigen Sicherheiten vereinbart wurden), (auf Rechnung des betreffenden Fonds) an die Gesellschaft übertragen werden können. Sicherheiten im Zusammenhang mit dem jeweiligen Swap- oder Repo-Kontrahenten kommen nicht für eine Aufnahme infrage.

Einzelheiten zur Höhe von den für umgekehrte Pensionsgeschäfte und OTC-Swaps erhaltenen Sicherheiten sind Anmerkung 5 („Sicherheiten“) zu entnehmen.

Festverzinsliche Wertpapiere

Staatsanleihen und supranationale Anleihen müssen ein langfristiges Kreditrating von mindestens AA bzw. AAA (Standard & Poor's) haben. Die Fälligkeit einer Staatsanleihe oder supranationalen Anleihe ist kein Kriterium für die Auswahl, sie ist jedoch für die Bestimmung des entsprechenden Bewertungsabschlags maßgeblich, der zwischen 0 % und 2 % liegt. Für die einzelnen Fonds gilt eine Konzentrationsbeschränkung von 20 % in Bezug auf jeden Emittenten (bei Staatsanleihen gilt die Beschränkung der Emittentenkonzentration je Emissionsland).

Aktien

Aktienwerte können nur dann als Sicherheiten übertragen werden, wenn sie eine Komponente eines in der Aufstellung der zulässigen Sicherheiten genannten bestimmten Index sind. Zusätzlich finden abhängig vom Index, in dem der Aktienwert enthalten ist, Bewertungsabschläge zwischen 5 % und 10 % Anwendung. Für die einzelnen Fonds gilt eine Konzentrationsbeschränkung von 5 % in Bezug auf jeden Emittenten sowie eine weitere Konzentrationsbeschränkung je Gründungsland der Emittenten, wobei diese Länderkonzentrationsbeschränkung je nach Gründungsland variiert. Letztlich darf kein Fonds mehr als 2,5 % der Marktkapitalisierung je Wertpapier und höchstens 100 % des 30-tägigen Durchschnitts des täglich gehandelten Werts je Wertpapier halten.

Als Sicherheiten dienende Wertpapiere, die vom jeweiligen Repo-Kontrahenten emittiert wurden, kommen nicht für eine Aufnahme infrage.

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
562.621.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	22.07.2022	562.621.724
555.448.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	555.448.724
546.860.859	Barclays Bank Plc	2,63 %	22.09.2022	546.860.859
532.478.859	Barclays Bank Plc	2,61 %	24.10.2022	532.478.859
523.666.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	22.07.2022	523.666.724
519.600.859	Barclays Bank Plc	2,63 %	22.09.2022	519.600.859
505.490.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	24.08.2022	505.490.724
497.434.859	Barclays Bank Plc	3,38 %	23.11.2022	497.434.859
494.163.859	Barclays Bank Plc	2,61 %	24.10.2022	494.163.859
492.636.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	22.07.2022	492.636.724
491.673.859	Barclays Bank Plc	4,15 %	22.12.2022	491.673.859
486.980.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	24.08.2022	486.980.724
476.544.859	Barclays Bank Plc	4,13 %	23.11.2022	476.544.859
475.383.859	Barclays Bank Plc	2,61 %	24.10.2022	475.383.859
467.021.859	Barclays Bank Plc	4,65 %	22.02.2023	467.021.859
464.028.859	Barclays Bank Plc	4,15 %	22.12.2022	464.028.859
463.520.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	24.08.2022	463.520.724
452.894.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.03.2023	452.894.859
447.819.859	Barclays Bank Plc	4,65 %	24.01.2023	447.819.859
444.671.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.02.2023	444.671.859
440.818.859	Barclays Bank Plc	4,15 %	22.12.2022	440.818.859
438.212.859	Barclays Bank Plc	5,15 %	24.05.2023	438.212.859
435.449.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.03.2023	435.449.859
423.756.859	Barclays Bank Plc	5,40 %	24.07.2023	423.756.859
423.003.859	Barclays Bank Plc	5,40 %	22.06.2023	423.003.859
421.874.859	Barclays Bank Plc	4,65 %	24.01.2023	421.874.859
420.327.859	Barclays Bank Plc	5,16 %	24.05.2023	420.327.859
418.224.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.03.2023	418.224.859
405.063.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	24.04.2023	405.063.859
403.393.859	Barclays Bank Plc	5,42 %	22.06.2023	403.393.859
401.034.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.03.2023	401.034.859
383.258.859	Barclays Bank Plc	5,15 %	24.04.2023	383.258.859

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
618.668.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	618.668.724
562.621.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	22.07.2022	562.621.724
555.448.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	555.448.724
546.860.859	Barclays Bank Plc	2,63 %	22.09.2022	546.860.859
532.478.859	Barclays Bank Plc	2,61 %	24.10.2022	532.478.859
523.666.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	22.07.2022	523.666.724
519.600.859	Barclays Bank Plc	2,63 %	22.09.2022	519.600.859
505.490.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	24.08.2022	505.490.724
497.434.859	Barclays Bank Plc	3,38 %	23.11.2022	497.434.859
494.163.859	Barclays Bank Plc	2,61 %	24.10.2022	494.163.859
492.636.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	22.07.2022	492.636.724
491.673.859	Barclays Bank Plc	4,15 %	22.12.2022	491.673.859
486.980.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	24.08.2022	486.980.724
476.544.859	Barclays Bank Plc	4,13 %	23.11.2022	476.544.859
475.383.859	Barclays Bank Plc	2,61 %	24.10.2022	475.383.859
467.021.859	Barclays Bank Plc	4,65 %	22.02.2023	467.021.858
464.028.859	Barclays Bank Plc	4,15 %	22.12.2022	464.028.859
463.520.724	Barclays Bank Plc	1,89 %	24.08.2022	463.520.724
452.894.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.03.2023	452.894.859
447.819.859	Barclays Bank Plc	4,65 %	24.01.2023	447.819.859
444.671.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.02.2023	444.671.859
440.818.859	Barclays Bank Plc	4,15 %	22.12.2022	440.818.859
438.212.859	Barclays Bank Plc	5,15 %	24.05.2023	438.212.859
435.449.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.03.2023	435.449.859
423.003.859	Barclays Bank Plc	5,40 %	22.06.2023	423.003.857
421.874.859	Barclays Bank Plc	4,65 %	24.01.2023	421.874.859
420.327.859	Barclays Bank Plc	5,16 %	24.05.2023	420.327.859
418.224.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.03.2023	418.224.859
405.063.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	24.04.2023	405.063.859
403.393.859	Barclays Bank Plc	5,42 %	22.06.2023	403.393.859
401.034.859	Barclays Bank Plc	4,90 %	22.03.2023	401.034.859
383.258.859	Barclays Bank Plc	5,15 %	24.04.2023	383.258.859

L&G Gold Mining UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
222.738	Newmont Corp	9.975.309
167.874	Agnico Eagle Mines Ltd (Units)	8.916.789
269.293	Barrick Gold Corp	4.326.398
214.910	Pan American Silver Corp	3.242.298
673.517	Kinross Gold Corp	3.171.874
216.279	Newcrest Mining Ltd	2.879.843
1.567.399	Westgold Resources Ltd	1.552.715
107.235	Lundin Gold Inc	1.270.611
1.225.085	Hochschild Mining Plc	1.263.737
71.313	AngloGold Ashanti Ltd	1.223.552
683.807	Evolution Mining Ltd	1.163.550
102.344	Gold Fields Ltd	1.052.917
160.704	First Majestic Silver Corp	1.012.771
394.552	IAMGOLD Corp	980.120
278.487	Coeur Mining Inc	912.762
252.249	Equinox Gold Corp	905.544
736.003	Gold Road Resources Ltd	888.894
1.185.445	Silver Lake Resources Ltd	873.541
125.900	Victoria Gold Corp	813.060
126.291	Northern Star Resources Ltd	790.118
229.762	Fortuna Silver Mines Inc	779.154
202.000	Karora Resources Inc	776.160
113.700	SilverCrest Metals Inc	774.566
167.600	Orla Mining Ltd	764.162
265.806	Capricorn Metals Ltd	739.182

L&G Gold Mining UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
1.302.283	Barrick Gold Corp	23.169.861
917.648	Yamana Gold Inc	5.248.990
237.094	AngloGold Ashanti Ltd	4.555.395
452.674	Fresnillo Plc	3.979.921
71.360	Newmont Corp	3.308.875
204.761	Newcrest Mining Ltd	3.305.458
452.035	Northern Star Resources Ltd	3.180.677
246.247	Gold Fields Ltd	2.821.318
661.800	Kinross Gold Corp	2.752.259
38.100	Agnico Eagle Mines Ltd (Units)	1.890.131
851.616	IAMGOLD Corp	1.545.220
167.400	Lundin Gold Inc	1.451.308
592.193	Evolution Mining Ltd	1.303.703
134.900	Alamos Gold Inc - Class A	1.267.721
75.000	Torex Gold Resources Inc	965.863
2.149.993	St Barbara Ltd	853.320
188.000	Equinox Gold Corp	818.224
1.387.568	Westgold Resources Ltd	747.784
213.932	Coeur Mining Inc	716.081
1.135.000	Calibre Mining Corp	629.637

L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
33.001.923	Citigroup Global Markets Limited	2,26 %	24.10.2022	33.001.923
33.001.923	Citigroup Global Markets Limited	2,28 %	22.09.2022	33.001.923
32.759.923	Citigroup Global Markets Limited	4,30 %	22.02.2023	32.759.923
32.759.923	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	22.03.2023	32.759.923
32.471.923	Citigroup Global Markets Limited	3,80 %	22.12.2022	32.471.923
32.471.923	Citigroup Global Markets Limited	3,03 %	23.11.2022	32.471.923
32.012.828	Citigroup Global Markets Limited	5,05 %	22.06.2023	32.012.828
32.012.828	Citigroup Global Markets Limited	5,05 %	24.07.2023	32.012.828
31.665.828	Citigroup Global Markets Limited	4,80 %	24.05.2023	31.665.828
31.611.923	Citigroup Global Markets Limited	2,26 %	24.10.2022	31.611.923
31.519.923	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	22.03.2023	31.519.923
30.665.828	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	24.04.2023	30.665.828
30.652.828	Merrill Lynch International	5,05 %	24.07.2023	30.652.828
30.460.923	Citigroup Global Markets Limited	4,30 %	24.01.2023	30.460.923
30.376.923	Citigroup Global Markets Limited	3,80 %	22.12.2022	30.376.923
30.235.828	Citigroup Global Markets Limited	4,80 %	24.05.2023	30.235.828
30.151.923	Citigroup Global Markets Limited	2,26 %	24.10.2022	30.151.923
30.109.923	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	22.03.2023	30.109.923
29.859.923	Citigroup Global Markets Limited	2,21 %	24.08.2022	29.859.923
29.190.828	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	24.04.2023	29.190.828
28.590.923	Merrill Lynch International	4,30 %	24.01.2023	28.590.923
28.164.923	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	22.07.2022	28.164.923

L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
33.001.923	Citigroup Global Markets Limited	2,26 %	24.10.2022	33.001.923
33.001.923	Citigroup Global Markets Limited	2,28 %	22.09.2022	33.001.923
32.759.923	Citigroup Global Markets Limited	4,30 %	22.02.2023	32.759.923
32.759.923	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	22.03.2023	32.759.923
32.471.923	Citigroup Global Markets Limited	3,80 %	22.12.2022	32.471.923
32.471.923	Citigroup Global Markets Limited	3,03 %	23.11.2022	32.471.923
32.012.828	Citigroup Global Markets Limited	5,05 %	22.06.2023	32.012.828
32.012.828	Citigroup Global Markets Limited	5,05 %	24.07.2023	32.012.828
31.665.828	Citigroup Global Markets Limited	4,80 %	24.05.2023	31.665.828
31.611.923	Citigroup Global Markets Limited	2,26 %	24.10.2022	31.611.923
31.519.923	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	22.03.2023	31.519.923
30.665.828	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	24.04.2023	30.665.828
30.460.923	Citigroup Global Markets Limited	4,30 %	24.01.2023	30.460.923
30.376.923	Citigroup Global Markets Limited	3,80 %	22.12.2022	30.376.923
30.235.828	Citigroup Global Markets Limited	4,80 %	24.05.2023	30.235.828
30.151.923	Citigroup Global Markets Limited	2,26 %	24.10.2022	30.151.923
30.109.923	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	22.03.2023	30.109.923
29.859.923	Citigroup Global Markets Limited	2,21 %	24.08.2022	29.859.923
29.294.923	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	22.07.2022	29.294.923
29.190.828	Citigroup Global Markets Limited	4,55 %	24.04.2023	29.190.828
28.590.923	Merrill Lynch International	4,30 %	24.01.2023	28.590.923
28.164.923	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	22.07.2022	28.164.923

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
275.229	QIAGEN NV	13.393.661
1.907.430	Ocado Group Plc	11.494.726
246.360	Azenta Inc	10.897.769
435.065	Symbotic Inc	8.559.596
249.200	Harmonic Drive Systems Inc	7.594.190
139.606	Omnicell Inc	7.165.297
65.968	iRhythm Technologies Inc	6.555.238
900.347	Luminar Technologies Inc - Class A	6.421.090
874.448	Hiwin Technologies Corp	5.971.777
21.382	Zebra Technologies Corp	5.798.267
3.913.604	AutoStore Holdings Ltd '144A'	5.618.035
182.361	Duerr AG	5.395.492
386.044	Stratasys Ltd	5.178.669
19.732	Intuitive Surgical Inc	5.001.209
97.894	Trimble Inc	4.956.277
40.816	IPG Photonics Corp	4.913.325
159.358	Airtac International Group	4.851.752
87.011	Globus Medical Inc	4.841.959
60.625	Ambarella Inc	4.507.787
11.268	Deere & Co	4.458.951
47.175	Teradyne Inc	4.360.256
20.654	Illumina Inc	4.311.952
75.941	FANUC Corp	4.277.249
10.025	Tecan Group AG	4.099.145
248.000	Yokogawa Electric Corp	4.075.106
40.311	Aptiv Plc	4.010.200
132.373	KION Group AG	3.997.872
100.797	GEA Group AG	3.941.507
140.932	Jenoptik AG	3.931.303
163.200	Nabtesco Corp	3.907.040
361.264	Hexagon AB	3.903.960
33.888	Krones AG	3.786.398
405.917	3D Systems Corp	3.786.372
76.175	Cognex Corp	3.736.430
105.805	Daifuku Co Ltd	3.727.936
236.856	Fuji Corp/Aichi	3.680.789
1.256.403	Estun Automation Co Ltd	3.657.333

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
23.688	Novanta Inc	3.644.387
7.972	ServiceNow Inc	3.514.316
20.179	NVIDIA Corp	3.455.414
165.000	THK Co Ltd	3.445.606
15.755	Nordson Corp	3.387.859
33.993	John Bean Technologies Corp	3.284.883
487.500	Elektro AB	3.107.514
25.475	QUALCOMM Inc	3.021.047
6.348	SMC Corp	3.003.994

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
352.394	iRobot Corp	20.353.474
47.039	NVIDIA Corp	13.524.589
306.100	Harmonic Drive Systems Inc	10.184.981
560.320	Samsara Inc	10.063.481
34.953	Intuitive Surgical Inc	9.911.498
480.486	Amano Corp	8.772.968
1.024.149	Materialise NV ADR	8.463.542
252.076	Global Unichip Corp	8.114.754
37.058	Manhattan Associates Inc	5.869.696
125.713	National Instruments Corp	5.620.205
166.975	Duerr AG	5.512.598
13.066	Tecan Group AG	4.972.337
34.683	Novanta Inc	4.846.290
19.193	Rockwell Automation Inc	4.700.140
42.052	IPG Photonics Corp	4.657.060
61.902	Omnicell Inc	4.465.108
41.353	Krones AG	4.415.473
23.061	Cadence Design Systems Inc	4.374.756
229.700	Yokogawa Electric Corp	4.221.263
82.750	Cognex Corp	4.081.551
2.302.259	AutoStore Holdings Ltd '144A'	4.072.168
21.859	Kardex Holding AG	4.035.369
93.046	Cargotec Oyj - Class B	3.945.885
7.417	ServiceNow Inc	3.858.088
228.840	Stratasys Ltd	3.857.625
27.914	Siemens AG	3.795.200
8.200	Keyence Corp	3.518.310
446.236	Hiwin Technologies Corp	3.409.401
8.131	Deere & Co	3.172.220
105.958	Airtac International Group	3.132.945
79.305	GEA Group AG	3.124.454
342.801	Delta Electronics Inc	3.124.418
20.900	FANUC Corp	3.022.707
99.000	Shibaura Machine Co Ltd	2.958.611
375.825	Iflytek Co Ltd 'A'	2.917.468
52.509	Azenta Inc	2.916.642
101.795	Jenoptik AG	2.857.594

L&G Cyber Security UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
7.203.260	SentinelOne Inc	145.774.334
1.716.979	Ziff Davis Inc	133.469.789
1.625.549	Cloudflare Inc	77.526.747
12.826.916	BlackBerry Ltd	55.228.367
2.736.186	Gen Digital Inc	51.885.714
563.698	Splunk Inc	49.101.655
12.674.960	Darktrace Plc	48.573.715
523.709	Akamai Technologies Inc	43.826.929
1.401.004	NetScout Systems Inc	42.775.697
372.485	CrowdStrike Holdings Inc	42.225.283
603.300	Trend Micro Inc/Japan	29.894.704
242.108	Check Point Software Technologies Ltd	29.604.888
1.140.421	Jamf Holding Corp	27.088.688
879.716	Juniper Networks Inc	25.730.143
472.589	Fortinet Inc	25.647.644
218.551	Qualys Inc	25.536.179
2.177.737	N-able Inc	22.922.107
140.830	Palo Alto Networks Inc	22.794.020
8.082.825	Rackspace Technology Inc	22.259.911
493.188	Cisco Systems Inc	21.891.973
153.344	CyberArk Software Ltd	21.420.756
6.263.414	Micro Focus International Plc	20.764.434
1.531.270	Softcat Plc	19.860.669
1.435.947	Atos SE	14.570.471
283.913	Rapid7 Inc	12.772.535

L&G Cyber Security UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
4.886.646	Ping Identity Holding Corp	138.716.942
1.124.813	VMware Inc	124.333.237
1.046.037	Cloudflare Inc	59.539.072
1.842.847	NetScout Systems Inc	58.745.967
385.948	Check Point Software Technologies Ltd	48.717.639
815.826	Fortinet Inc	48.621.790
210.517	Palo Alto Networks Inc	45.475.982
335.525	Qualys Inc	42.345.617
1.370.931	Juniper Networks Inc	42.266.824
844.142	Cisco Systems Inc	39.208.353
3.426.709	Absolute Software Corp	38.589.127
602.047	SailPoint Technologies Holdings Inc	37.973.673
1.638.273	Gen Digital Inc	36.413.765
6.263.414	Micro Focus International Plc	36.278.489
681.900	Trend Micro Inc/Japan	35.026.067
7.882.157	BlackBerry Ltd	34.439.862
414.151	Ziff Davis Inc	33.487.582
364.689	Splunk Inc	33.143.629
3.099.767	Sumo Logic Inc	33.004.375
224.905	CyberArk Software Ltd	32.127.862
2.630.795	Fastly Inc	30.874.050
12.884.785	NCC Group Plc	29.637.100
195.486	CrowdStrike Holdings Inc	26.392.013
297.442	Akamai Technologies Inc	25.977.951
485.719	Parsons Corp	19.997.231
213.484	Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A	19.927.136
987.750	SentinelOne Inc	19.891.244
1.336.738	A10 Networks Inc	19.366.538
716.852	Radware Ltd	15.072.771
3.842.863	Darktrace Plc	14.751.993

L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
1.170.100	Toshiba Corp	40.364.926
2.495.031	Wartsila OYJ Abp	29.766.715
31.088.020	Core Lithium Ltd	23.483.064
119.372	Tesla Inc	22.887.293
619.052	HD Hyundai Electric Co Ltd	18.961.904
8.260.921	Eos Energy Enterprises Inc	18.597.653
56.531	SolarEdge Technologies Inc	16.647.582
572.128	Livent Corp	15.194.281
4.201.800	Nissan Motor Co Ltd	15.086.941
98.246	Volkswagen AG - Preference	14.062.396
1.080.306	Ivanhoe Electric Inc / US	13.816.544
503.372	BYD Co Ltd 'H'	12.863.239
3.974.723	Pilbara Minerals Ltd	12.520.352
193.572	Mercedes-Benz Group AG	12.405.514
1.228.136	Allkem Ltd	12.275.407
333.025	AMG Critical Materials NV	12.012.089
127.162	Bayerische Motoren Werke AG	11.039.123
940.800	Sumitomo Electric Industries Ltd	10.827.548
1.156.800	Panasonic Holdings Corp	9.975.728
327.934	ABB Ltd	9.942.234
118.974	EnerSys	8.710.110
234.050	Renault SA	7.743.909
221.500	TDK Corp	7.636.926
194.362	Sebang Global Battery Co Ltd	7.625.939
797.899	Delta Electronics Inc	7.250.887
147.083	Mineral Resources Ltd	7.179.949
526.200	NGK Insulators Ltd	6.911.115
18.030	LG Energy Solution Ltd	6.780.705
1.709.985	ESS Tech Inc	6.287.125
12.677	Samsung SDI Co Ltd	6.025.384
249.300	GS Yuasa Corp	4.327.309
812.372	Bollere SE	4.262.712

L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
472.327	General Electric Co	39.695.813
26.701.446	Taiwan Cement Corp	28.717.577
9.238.400	Pilbara Minerals Ltd	28.253.934
679.147	AMG Critical Materials NV	23.142.417
226.666	Bayerische Motoren Werke AG	23.024.815
613.277	Renault SA	20.811.005
68.429	SolarEdge Technologies Inc	20.042.436
212.902	EnerSys	16.744.618
40.742	LG Energy Solution Ltd	16.649.857
488.073	ABB Ltd	16.491.217
219.394	Mercedes-Benz Group AG	15.229.850
467.933	BYD Co Ltd 'H'	13.731.881
1.450.000	Delta Electronics Inc	13.589.177
1.151.000	Sumitomo Electric Industries Ltd	13.467.748
1.306.800	Panasonic Holdings Corp	12.219.945
235.202	Mineral Resources Ltd	11.947.564
334.543	HD Hyundai Electric Co Ltd	10.932.447
2.987.600	Nissan Motor Co Ltd	10.753.392
300.400	TDK Corp	10.451.012
745.700	NGK Insulators Ltd	9.633.919
61.864	Volkswagen AG - Preference	8.348.352
912.042	Allkem Ltd	8.105.008
239.339	Livent Corp	6.424.206
13.106	Samsung SDI Co Ltd	6.177.825
24.166	Tesla Inc	5.616.615
890.846	Bolloré SE	5.108.363
3.680.266	ESS Tech Inc	4.581.750

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
13.377	BeiGene Ltd ADR	2.514.262
84.899	Xencor Inc	2.489.357
26.291	Horizon Therapeutics Plc	2.412.125
1.657.240	SciClone Pharmaceuticals Holdings Ltd '144A'	2.315.504
100.386	Travere Therapeutics Inc	2.303.662
39.800	Eisai Co Ltd	2.299.108
105.897	Kyowa Kirin Co Ltd	2.292.946
25.995	Sanofi	2.282.069
202.900	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	2.265.166
34.219	AstraZeneca Plc ADR	2.263.700
61.730	Supernus Pharmaceuticals Inc	2.220.986
6.037	Genmab A/S	2.182.934
408.778	Innovent Biologics Inc '144A'	2.143.265
185.242	Amicus Therapeutics Inc	2.121.128
250.306	BioCryst Pharmaceuticals Inc	2.017.356
13.935	Seagen Inc	1.998.139
166.753	Emergent BioSolutions Inc	1.956.301
431.704	Bluebird Bio Inc	1.930.419
140.223	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	1.875.748
36.625	Nippon Shinyaku Co Ltd	1.817.401
53.734	Zai Lab Ltd ADR	1.793.738
389.870	CTI BioPharma Corp	1.741.945
14.172	Sarepta Therapeutics Inc	1.733.739
6.230	Biogen Inc	1.712.488
47.561	Halozyne Therapeutics Inc	1.577.315
59.690	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	1.542.928
13.300	Ipsen SA	1.475.424
32.818	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	1.442.334
117.184	Grifols SA	1.435.631
5.235	United Therapeutics Corp	1.311.295
13.000	BioMarin Pharmaceutical Inc	1.302.761
4.290	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.302.104
16.918	Incyte Corp	1.292.999
8.430	AbbVie Inc	1.286.970
2.305.683	Sino Biopharmaceutical Ltd	1.278.389
17.713	Bristol-Myers Squibb Co	1.273.531
28.964	PTC Therapeutics Inc	1.269.797
8.658	Jazz Pharmaceuticals Plc	1.256.166
5.945	Alnylam Pharmaceuticals Inc	1.239.700

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
13.938	Novartis AG ADR	1.208.036
54.955	Swedish Orphan Biovitrum AB	1.186.890
3.573	Roche Holding AG	1.137.010
16.059	Pharma Mar SA	1.029.852
5.035	CSL Ltd	999.424
16.420	Basilea Pharmaceutica AG	774.828

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
389.870	CTI BioPharma Corp	3.538.320
13.935	Seagen Inc	2.751.657
25.995	Sanofi	2.468.340
15.578	AbbVie Inc	2.397.430
22.243	Horizon Therapeutics Plc	2.322.364
4.125.686	Sino Biopharmaceutical Ltd	2.296.626
26.637	Novartis AG ADR	2.183.733
61.730	Supernus Pharmaceuticals Inc	2.155.543
185.242	Amicus Therapeutics Inc	2.079.052
10.703	CSL Ltd	2.045.944
17.211	Sarepta Therapeutics Inc	1.971.039
6.525	Roche Holding AG	1.851.403
4.992	Genmab A/S	1.841.143
42.906	Halozyme Therapeutics Inc	1.706.064
34.010	Pharma Mar SA	1.676.226
179.108	Grifols SA	1.669.159
73.082	Kyowa Kirin Co Ltd	1.568.119
33.425	Ionis Pharmaceuticals Inc	1.548.390
5.330	Biogen Inc	1.465.299
6.615	BeiGene Ltd ADR	1.388.923
25.740	PTC Therapeutics Inc	1.267.997
6.370	Johnson & Johnson	1.067.481
4.818	United Therapeutics Corp	1.054.396
9.135	Ipsen SA	1.036.186
3.164	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.034.447
10.966	BioMarin Pharmaceutical Inc	1.002.664
33.628	Xencor Inc	911.627
4.428	Alnylam Pharmaceuticals Inc	886.476

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
16.420	Basilea Pharmaceutica AG	882.847
41.848	Swedish Orphan Biovitrum AB	858.960
66.899	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	850.980
27.500	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	763.118
11.172	Incyte Corp	736.487
15.400	Nippon Shinyaku Co Ltd	690.261
10.300	Eisai Co Ltd	687.541
14.137	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	677.569
9.195	AstraZeneca Plc ADR	668.382
9.604	Bristol-Myers Squibb Co	632.975

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
751.203	Segro Plc (REIT)	7.517.211
5.588.194	Mapletree Logistics Trust (REIT)	7.441.489
941.970	Ocado Group Plc	5.547.449
197.734	Zalando SE '144A'	5.061.590
2.403	AP Moller - Maersk A/S - Class B	4.826.186
141.797	Shopify Inc - Class A	4.543.761
78.556	NTG Nordic Transport Group A/S	4.287.190
34.134	Amazon.com Inc	3.721.543
792.700	Rakuten Group Inc	3.659.230
55.864	CJ Logistics Corp	3.457.161
27.314	Concentrix Corp	3.115.859
21.940	DSV A/S	3.047.775
1.814.655	JD Logistics Inc '144A'	3.032.786
69.215	Mainfreight Ltd	2.920.272
72.441	GXO Logistics Inc	2.827.666
75.733	DHL Group	2.771.521
25.159	Prologis Inc (REIT)	2.755.521
63.692	eBay Inc	2.627.955
11.951	FedEx Corp	2.136.881
9.162	Kuehne + Nagel International AG	2.116.787
23.903	Ryder System Inc	2.003.348
35.900	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	1.973.818
20.065	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.820.835
18.947	TD SYNnex Corp	1.783.538
22.102	Oracle Corp	1.767.627
16.886	SAP SE	1.742.966
9.117	United Parcel Service Inc - Class B	1.621.573
119.444	Vipshop Holdings Ltd ADR	1.518.661
10.139	Manhattan Associates Inc	1.403.098
12.277	Expeditors International of Washington Inc	1.297.200
9.331	SPS Commerce Inc	1.263.648
17.233	Descartes Systems Group Inc/The	1.243.620
8.750	Walmart Inc	1.237.044
145.800	Japan Post Holdings Co Ltd	1.146.413

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
146.483	Logisteed Ltd	9.304.505
298.694	Kintetsu World Express Inc	9.145.853
438.556	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	8.370.505
1.489.756	Bollore SE	6.913.994
171.458	Zalando SE '144A'	6.506.527
479.201	Vipshop Holdings Ltd ADR	6.086.703
271.718	Nippon Yusen KK	5.471.830
2.996.016	Kerry Logistics Network Ltd	4.773.221
100.151	Shopify Inc - Class A	4.599.378
818.391	bpost SA	4.379.501
644.100	Senko Group Holdings Co Ltd	4.376.112
23.454	DSV A/S	4.046.778
43.107	Oracle Corp	3.762.568
32.355	SAP SE	3.755.894
87.062	DHL Group	3.744.966
16.646	FedEx Corp	3.528.774
44.129	Ryder System Inc	3.425.714
1.500.000	Dimerco Express Corp	3.303.944
12.242	Kuehne + Nagel International AG	3.291.672
111.588	NTG Nordic Transport Group A/S	3.280.679
63.129	GXO Logistics Inc	3.106.452
19.586	Manhattan Associates Inc	2.702.000
19.092	SPS Commerce Inc	2.517.482
35.870	Descartes Systems Group Inc/The	2.460.853
335.100	Japan Post Holdings Co Ltd	2.459.572
356.884	Ocado Group Plc	2.403.379
22.930	Expeditors International of Washington Inc	2.310.066
21.953	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.922.133
13.287	Walmart Inc	1.854.857
40.987	Mainfreight Ltd	1.775.439
18.813	TD SYNnex Corp	1.768.507
14.739	Prologis Inc (REIT)	1.764.723
9.345	United Parcel Service Inc - Class B	1.682.629
30.200	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	1.678.330
799	AP Moller - Maersk A/S - Class B	1.663.345
36.912	eBay Inc	1.597.225
22.759	CJ Logistics Corp	1.588.355
885.179	JD Logistics Inc '144A'	1.586.534
12.478	Concentrix Corp	1.460.469
12.819	Amazon.com Inc	1.458.219

L&G Clean Water UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
45.128	IDEX Corp	9.463.790
71.055	Ferguson Plc	9.146.325
508.831	Primo Water Corp	7.305.978
74.769	Middlesex Water Co	6.065.172
66.576	Advanced Drainage Systems Inc	5.679.700
248.517	Zurn Elkay Water Solutions Corp	5.604.206
521.683	Pennon Group Plc	5.530.665
321.446	Kemira Oyj	5.243.499
4.655.884	China Lesso Group Holdings Ltd	4.883.772
93.020	Trimble Inc	4.881.620
33.295	American Water Works Co Inc	4.822.390
379.299	United Utilities Group Plc	4.709.331
142.229	Severn Trent Plc	4.666.517
173.900	Nomura Micro Science Co Ltd	4.660.887
1.353.819	Rotork Plc	4.304.442
16.710.466	Beijing Enterprises Water Group Ltd	4.184.926
70.461	California Water Service Group	4.112.450
8.480	Geberit AG	4.083.027
9.676	Roper Technologies Inc	4.027.951
222.730	Consolidated Water Co Ltd	3.959.300
44.226	American States Water Co	3.943.152
97.172	Evoqua Water Technologies Corp	3.929.321
54.874	Sulzer AG	3.885.905
95.789	Aalberts NV	3.820.198
81.535	Pentair Plc	3.791.373
24.302	Ecolab Inc	3.776.359
24.745	Lindsay Corp	3.697.277
359.941	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP ADR	3.617.183
214.172	Norma Group SE	3.575.737
162.377	Energy Recovery Inc	3.539.294
185.064	Uponor Oyj	3.395.841
2.541	Mettler-Toledo International Inc	3.391.287
58.309	A O Smith Corp	3.353.241
147.136	Core & Main Inc - Class A	3.233.510
263.576	Mueller Water Products Inc - Class A	3.128.356
15.527	Kadant Inc	2.942.904
29.003	Xylem Inc/NY	2.938.830
40.586	SJW Group	2.912.788
51.625	Artesian Resources Corp - Class A	2.870.311
18.675	Watts Water Technologies Inc - Class A	2.838.868
98.957	Alfa Laval AB	2.836.479

L&G Clean Water UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
31.147	Franklin Electric Co Inc	2.758.390
24.934	Badger Meter Inc	2.742.843
71.291	Bentley Systems Inc - Class B	2.711.159
129.334	NOV Inc	2.709.991
64.100	Kurita Water Industries Ltd	2.667.388
279.844	Metso Oyj	2.666.232
80.778	Northwest Pipe Co	2.530.588
98.600	Organo Corp	2.449.939
45.410	Itron Inc	2.415.718

L&G Clean Water UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
324.276	Alfa Laval AB	10.338.643
490.317	NOV Inc	8.533.317
111.190	Ingevity Corp	7.318.866
25.739	Danaher Corp	7.132.553
258.633	Norma Group SE	6.890.070
2.454.096	TETRA Technologies Inc	6.843.196
74.178	Sulzer AG	5.903.640
5.342.256	Guangdong Investment Ltd	4.744.910
332.328	Kemira Oyj	4.079.975
289.373	Uponor Oyj	3.996.291
116.554	Northwest Pipe Co	3.648.130
222.730	Consolidated Water Co Ltd	3.272.125
340.604	Metso Oyj	3.208.552
11.344.000	Beijing Enterprises Water Group Ltd	2.794.868
59.109	Evoqua Water Technologies Corp	2.675.011
685.104	Rotork Plc	2.514.683
2.846.475	China Water Affairs Group Ltd	2.463.767
98.684	Gorman-Rupp Co/The	2.399.504
170.981	Primo Water Corp	2.355.169
52.001	Aalberts NV	2.322.836
95.979	Energy Recovery Inc	2.290.010
80.000	Organo Corp	2.247.982
66.100	Nomura Micro Science Co Ltd	1.983.440
573.687	Genuit Group Plc	1.896.018
16.349	Badger Meter Inc	1.892.892
12.820	Lindsay Corp	1.877.492
300.600	Kitz Corp	1.856.815
195.534	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP ADR	1.819.371
11.291	Watts Water Technologies Inc - Class A	1.799.213
15.706	Advanced Drainage Systems Inc	1.625.968
30.658	Pentair Plc	1.580.458
119.958	Mueller Water Products Inc - Class A	1.555.563
15.859	Xylem Inc/NY	1.547.652
66.213	Core & Main Inc - Class A	1.529.931
1.019	Mettler-Toledo International Inc	1.461.685

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
163.297	Alteryx Inc - Class A	7.659.100
47.973	Crowdstrike Holdings Inc	7.162.789
147.325	Rapid7 Inc	6.295.947
81.986	Twilio Inc - Class A	5.182.274
49.402	Etsy Inc	4.854.310
50.690	Datadog Inc	4.852.267
45.954	Splunk Inc	4.610.372
249.859	Lemonade Inc	4.332.952
20.274	Autodesk Inc	4.193.624
53.479	Ambarella Inc	4.142.874
22.374	Analog Devices Inc	4.054.440
156.772	Varonis Systems Inc - Class B	4.019.635
18.205	Palo Alto Networks Inc	3.884.909
16.429	MongoDB Inc - Class A	3.856.301
74.232	Cognex Corp	3.827.627
36.891	Amazon.com Inc	3.758.109
18.301	Tesla Inc	3.713.987
1.627.688	Butterfly Network Inc	3.691.948
90.179	JD.com Inc ADR	3.678.835
62.828	Cloudflare Inc	3.677.526
34.187	Alphabet Inc - Class A	3.655.148
1.037.503	Darktrace Plc	3.611.545
5.581	ASML Holding NV NY Reg Shrs	3.554.001
22.898	Atlassian Corp	3.539.880
129.067	Pure Storage Inc	3.519.835
158.000	MediaTek Inc	3.509.731
38.103	Advanced Micro Devices Inc	3.402.166
15.775	NVIDIA Corp	3.397.848
37.984	Alibaba Group Holding Ltd ADR	3.331.450
27.267	Electronic Arts Inc	3.289.152
24.861	International Business Machines Corp	3.228.358
11.535	Accenture Plc - Class A	3.165.520
6.626	ServiceNow Inc	3.162.538
10.872	Microsoft Corp	3.150.397
44.741	New Relic Inc	3.035.149
64.154	Shopify Inc - Class A	2.982.503
166.741	Samsara Inc	2.948.863
14.129	Illumina Inc	2.946.976
15.619	Veeva Systems Inc - Class A	2.828.970
17.782	Snowflake Inc	2.821.157
42.339	Block Inc	2.792.682

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
29.367	Teradyne Inc	2.746.340
7.452	Adobe Inc	2.711.520
135.961	C3.ai Inc	2.641.263
64.312	Dassault Systemes SE	2.602.519
142.830	Gen Digital Inc	2.561.662
4.911	Lam Research Corp	2.534.818
149.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.502.503
102.071	Veracyte Inc	2.468.705
16.321	Arista Networks Inc	2.457.564
6.153	HubSpot Inc	2.385.451
11.834	Verisk Analytics Inc - Class A	2.337.188
1.028	Booking Holdings Inc	2.320.265
30.436	CoStar Group Inc	2.258.665
20.790	Spotify Technology SA	2.221.865
67.950	Infineon Technologies AG	2.209.678

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
957.136	Yext Inc	9.423.436
17.441	Netflix Inc	6.476.789
90.266	iRobot Corp	5.223.555
55.252	Wix.com Ltd	4.613.421
15.330	NVIDIA Corp	4.271.747
11.930	MongoDB Inc - Class A	3.757.410
45.890	Zendesk Inc	3.553.108
87.189	Tencent Holdings Ltd	3.530.552
118.271	C3.ai Inc	3.349.447
29.623	Baidu Inc ADR	3.334.161
98.000	Global Unichip Corp	3.153.031
107.764	Veracyte Inc	2.596.504
1.665.883	Kingdee International Software Group Co Ltd	2.594.044
13.166	Salesforce Inc	2.488.564
51.216	Shopify Inc - Class A	2.335.835
3.781	Fair Isaac Corp	2.272.927
16.313	Spotify Technology SA	2.208.946
386.996	Butterfly Network Inc	2.120.904
18.026	Etsy Inc	2.067.383
35.338	Alteryx Inc - Class A	2.050.362
109.693	Samsara Inc	2.039.134
15.679	Amazon.com Inc	1.946.327
96.147	CD Projekt SA	1.793.558
50.686	Pure Storage Inc	1.784.667
8.194	Verisk Analytics Inc - Class A	1.749.200
42.256	Rapid7 Inc	1.669.633
25.698	New Relic Inc	1.632.406
647.603	Appen Ltd	1.523.459
24.053	Twilio Inc - Class A	1.519.799
3.156	Adobe Inc	1.516.129
1.387	MercadoLibre Inc	1.458.120
4.235	Accenture Plc - Class A	1.336.375
54.474	Upstart Holdings Inc	1.333.270
10.975	Arista Networks Inc	1.317.446
39.277	Infineon Technologies AG	1.304.739
7.632	Atlassian Corp	1.279.804
300.634	Darktrace Plc	1.260.326
50.429	JFrog Ltd	1.241.061
526	Booking Holdings Inc	1.225.248
2.988	HubSpot Inc	1.219.887

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
49.568	QIAGEN NV	2.417.003
73.438	Privia Health Group Inc	2.305.545
192.410	CareDx Inc	2.143.211
435.713	Codexis Inc	1.799.755
22.350	GE HealthCare Technologies Inc	1.707.800
35.887	Azenta Inc	1.656.381
257.478	Fate Therapeutics Inc	1.582.695
33.655	Integra LifeSciences Holdings Corp	1.534.274
70.872	Twist Bioscience Corp	1.404.540
3.274	Bio-Rad Laboratories Inc	1.338.712
28.803	CRISPR Therapeutics AG	1.331.929
24.232	Omnicell Inc	1.317.276
142.651	NanoString Technologies Inc	1.313.016
23.537	Catalent Inc	1.302.841
128.535	Editas Medicine Inc	1.278.155
76.049	Koninklijke Philips NV	1.260.481
9.592	Revvity Inc	1.227.858
392.731	Cerus Corp	1.172.709
24.238	Natera Inc	1.160.644
10.885	iRhythm Technologies Inc	1.146.496
7.948	Moderna Inc	1.137.542
19.463	STAAR Surgical Co	1.136.685
5.453	Charles River Laboratories International Inc	1.122.159
4.602	Stryker Corp	1.109.913
4.338	Align Technology Inc	1.093.995
35.868	Guardant Health Inc	1.071.251
15.694	Eurofins Scientific SE	1.057.356
29.600	Fulgent Genetics Inc	1.044.716
434.170	Butterfly Network Inc	1.020.342
91.265	Health Catalyst Inc	1.012.657
8.800	DiaSorin SpA	1.005.664
9.059	Abbott Laboratories	945.002
126.031	JD Health International Inc '144A'	942.937
29.798	Nevro Corp	927.159
12.913	Incyte Corp	895.406
18.662	Baxter International Inc	880.479
4.443	Alnylam Pharmaceuticals Inc	880.387
4.123	Illumina Inc	865.733
6.632	Agilent Technologies Inc	857.853
12.485	Bristol-Myers Squibb Co	857.038
10.408	Edwards Lifesciences Corp	852.138

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
3.417	Intuitive Surgical Inc	838.866
3.282	Danaher Corp	823.749
1.053	Regeneron Pharmaceuticals Inc	794.746
8.895	QuidelOrtho Corp	778.019
2.514	Insulet Corp	750.574
23.742	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	747.341

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
8.187	ABIOMED Inc	2.996.880
82.081	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	2.874.408
52.291	Glaukos Corp	2.655.227
217.327	Editas Medicine Inc	2.424.799
157.740	Tactile Systems Technology Inc	2.320.185
9.416	Penumbra Inc	2.156.540
40.512	Catalent Inc	2.145.453
300.473	Fate Therapeutics Inc	1.873.127
9.029	Alnylam Pharmaceuticals Inc	1.851.960
36.076	Natera Inc	1.808.601
28.944	Exact Sciences Corp	1.729.763
28.803	CRISPR Therapeutics AG	1.661.807
6.007	Intuitive Surgical Inc	1.648.551
15.708	Dexcom Inc	1.633.258
8.415	CSL Ltd	1.629.933
71.953	Veracyte Inc	1.617.426
241.601	NanoString Technologies Inc	1.491.417
4.814	Align Technology Inc	1.444.811
65.228	EMIS Group Plc	1.408.291
125.338	Grifols SA	1.402.400
155.711	Materialise NV ADR	1.308.783
39.483	Twist Bioscience Corp	1.300.062
4.585	Insulet Corp	1.228.891
25.234	Guardant Health Inc	1.203.693
15.555	STAAR Surgical Co	1.202.292
246.825	Butterfly Network Inc	1.135.182
49.934	GN Store Nord AS	1.088.717
5.511	Medpace Holdings Inc	1.076.479
15.471	Omnicell Inc	1.075.491
4.135	Stryker Corp	1.019.002
6.095	Moderna Inc	1.009.320
125.212	JD Health International Inc '144A'	1.005.598
1.402	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.003.287
2.543	Tecan Group AG	976.762
32.186	Teladoc Health Inc	972.042
50.989	Koninklijke Philips NV	927.555
79.306	Health Catalyst Inc	916.697
20.228	Boston Scientific Corp	908.730
16.320	Integra LifeSciences Holdings Corp	844.065

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten €
108.493	Nestle SA	12.115.572
16.154	ASML Holding NV	10.971.167
64.713	Novo Nordisk A/S	9.625.197
10.045	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	8.396.985
27.692	Roche Holding AG	8.208.507
60.670	AstraZeneca Plc	8.090.211
87.273	Novartis AG	7.792.801
806.785	HSBC Holdings Plc	5.610.847
41.077	SAP SE	5.000.126
99.912	Unilever Plc	4.703.280
29.673	Siemens AG	4.603.028
43.141	Sanofi	4.079.082
9.452	L'Oreal SA	3.819.409
88.229	Diageo Plc	3.497.811
21.263	Schneider Electric SE	3.492.104
16.071	Allianz SE	3.332.850
20.873	Air Liquide SA	3.328.029
20.323	Cie Financiere Richemont SA	3.128.008
143.427	Deutsche Telekom AG	2.944.030
41.216	Mercedes-Benz Group AG	2.811.270

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse €
6.809	Linde Plc/old	2.190.008
17.078	Novartis AG	1.512.778
9.601	Nestle SA	1.079.575
124.864	HSBC Holdings Plc	821.595
1.318	ASML Holding NV	721.599
971	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	708.421
2.227	Roche Holding AG	686.177
36.484	UBS Group AG	672.875
5.134	AstraZeneca Plc	658.026
2.768	MTU Aero Engines AG	617.891
4.780	Novo Nordisk A/S	600.329
2.266	Allianz SE	443.801
6.162	Prosus NV	418.471
8.036	Unilever Plc	378.075
3.006	Siemens AG	377.837

L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse €
2.944	Ferguson Plc	353.688
6.458	BNP Paribas SA	351.962
3.456	SAP SE	351.740
10.854	ABB Ltd	339.175
30.088	Iberdrola SA	327.095

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
265.150	Apple Inc	45.589.962
86.943	Microsoft Corp	28.321.026
44.618	NVIDIA Corp	16.505.473
130.494	Amazon.com Inc	14.541.649
66.589	Tesla Inc	11.849.037
77.629	Alphabet Inc	9.161.646
69.393	Alphabet Inc - Class A	8.434.757
92.884	NextEra Energy Inc	7.003.290
27.369	Meta Platforms Inc - Class A	6.976.240
36.278	Johnson & Johnson	5.638.421
11.260	UnitedHealth Group Inc	5.403.657
7.249	Broadcom Inc	5.394.464
12.776	Eli Lilly & Co	5.301.881
36.133	Procter & Gamble Co/The	5.238.572
35.221	JPMorgan Chase & Co	4.724.025
41.687	Merck & Co Inc	4.609.322
18.415	Visa Inc - Class A	4.090.209
11.099	Linde Plc	4.082.764
12.299	Berkshire Hathaway Inc - Class B	3.882.455
20.837	PepsiCo Inc	3.822.059

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
140.294	Amazon.com Inc	17.260.674
85.814	Apple Inc	13.111.643
39.340	Tesla Inc	10.104.051
15.811	Costco Wholesale Corp	7.706.348
19.552	Microsoft Corp	4.858.890
18.234	Caterpillar Inc	4.194.946
24.190	Alphabet Inc	2.362.660
20.233	Alphabet Inc - Class A	2.034.397
12.900	JPMorgan Chase & Co	1.751.349
13.977	Prologis Inc (REIT)	1.677.998
4.774	Linde Plc	1.614.822
2.695	UnitedHealth Group Inc	1.431.563
44.992	Bank of America Corp	1.386.922
7.039	American Tower Corp (REIT)	1.371.345

L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
30.507	Wells Fargo & Co	1.318.761
7.992	Meta Platforms Inc - Class A	1.305.300
29.622	Uber Technologies Inc	1.248.729
8.229	Ecolab Inc	1.196.623
8.369	Procter & Gamble Co/The	1.182.359
7.645	AbbVie Inc	1.126.466

*Mit Wirkung vom 4. November 2022 wurde der Name des Fonds von L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF in L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF geändert.

L&G Clean Energy UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
8.074.904	Saipem SpA	12.682.650
1.369.951	Azure Power Global Ltd	7.795.235
358.849	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	6.935.749
66.730	Nexans SA	6.365.942
187.162	Energia Innovacion y Desarrollo Fotovoltaico SA	5.985.790
301.061	Siemens Energy AG	5.880.298
316.949	PNE AG	5.553.799
184.473	Neoen SA '144A'	5.508.607
200.400	West Holdings Corp	5.395.591
524.100	Marubeni Corp	5.163.052
195.159	AES Corp/The	5.063.975
664.843	Scatec ASA '144A'	4.842.989
96.761	Ameresco Inc - Class A	4.828.109
177.573	Northland Power Inc	4.642.786
21.983	Tesla Inc	4.601.403
49.837	Orsted AS '144A'	4.268.768
51.641	Alfen N.V. '144A'	4.254.476
145.397	Boralex Inc	4.213.947
52.390	NextEra Energy Inc	4.085.277
841.714	Emeren Group Ltd ADR	3.996.408
6.363.728	Obrascon Huarte Lain SA	3.878.676
17.922	Enphase Energy Inc	3.745.666
124.087	ERG SpA	3.690.433
166.225	EDP Renovaveis SA	3.555.210
524.227	Soltec Power Holdings SA	3.388.246
344.651	Nordex SE	3.335.803
290.400	Sumitomo Electric Industries Ltd	3.314.291
17.215	Acciona SA	3.221.397
100.000	Mitsubishi Corp	3.144.888
37.018	Ormat Technologies Inc	3.087.338
490.200	Hitachi Zosen Corp	3.033.957
170.018	Array Technologies Inc	2.985.592
277.195	Iberdrola SA	2.930.018
125.496	Vestas Wind Systems A/S	2.922.760
10.389	SolarEdge Technologies Inc	2.908.899
307.633	Worley Ltd	2.870.403
81.911	Canadian Solar Inc	2.863.684
228.595	Fugro NV	2.684.389
20.715	Schneider Electric SE	2.654.809
77.890	Grenergy Renovables SA	2.649.743
76.100	Toyota Tsusho Corp	2.622.816
197.621	Engie SA	2.621.874

L&G Clean Energy UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
29.901	Energiekontor AG	2.581.566
104.021	Valmet Oyj	2.501.653
255.200	Mitsubishi Electric Corp	2.474.678
51.262	CS Wind Corp	2.371.089
370.358	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	2.349.300
19.877	WSP Global Inc	2.349.264
699.667	Downer EDI Ltd	2.163.974

L&G Clean Energy UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
8.138.167	Saipem SpA	10.034.173
579.938	Subsea 7 SA	6.793.700
151.695	Toyota Tsusho Corp	6.097.387
109.471	CS Wind Corp	5.908.692
517.075	Mitsubishi Electric Corp	5.895.569
43.746	WSP Global Inc	5.483.004
316.949	PNE AG	5.223.034
266.704	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	5.097.885
29.961	First Solar Inc	4.931.457
1.353.998	Aker Solutions ASA	4.917.153
269.996	Encavis AG	4.862.094
239.894	Array Technologies Inc	4.528.749
195.159	AES Corp/The	4.431.726
318.323	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	4.367.195
340.524	TPI Composites Inc	4.117.475
58.180	Energiekontor AG	3.981.009
52.218	SMA Solar Technology AG	3.883.164
1.528.714	Downer EDI Ltd	3.493.952
2.263.606	CTCI Corp	3.436.441
7.947	Samsung SDI Co Ltd	3.435.395
208.494	Yokogawa Electric Corp	3.419.056
3.489.987	Centrica Plc	3.230.895
382.341	Delta Electronics Inc	3.216.383
12.446	Enphase Energy Inc	3.201.083
75.351	Enbridge Inc	3.090.131
146.548	Sumitomo Heavy Industries Ltd	2.950.892
92.431	Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	2.924.036
290.674	Atlas Copco AB	2.864.240
289.978	E.ON SE	2.499.932
180.181	Nordex SE	2.442.021
811.375	Azure Power Global Ltd	2.379.164
391.383	Peab AB	2.375.963
2.529.985	China Steel Corp	2.365.507
51.975	Canadian Solar Inc	2.114.826
421.256	American Superconductor Corp	2.085.990
145.749	Fugro NV	1.944.395

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten £
3.500.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2028	2.963.760
1.900.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2024	1.817.985
1.600.000	Nationwide Building Society FRN	6,18 %	07.12.2027	1.629.887
985.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN' FRN	7,10 %	16.11.2027	987.212
1.000.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN'	4,87 %	06.05.2026	979.888
1.000.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' FRN	3,47 %	26.04.2028	970.965
1.000.000	Deutsche Bank AG 'EMTN'	2,63 %	16.12.2024	948.650
1.000.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,13 %	11.02.2027	925.827
947.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN	4,00 %	17.08.2027	917.046
1.000.000	HSBC Holdings Plc FRN	1,75 %	24.07.2027	916.980
950.000	New York Life Global Funding 'EMTN'	1,50 %	15.07.2027	820.196
900.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN	1,50 %	03.12.2026	809.425
748.000	New York Life Global Funding 'EMTN'	4,35 %	16.09.2025	745.928
800.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	0,74 %	29.10.2025	735.610
800.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,00 %	16.07.2026	725.047
700.000	Credit Agricole SA FRN	5,75 %	29.11.2027	703.045
700.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	5,13 %	22.02.2028	698.551
700.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,13 %	17.01.2024	685.597
600.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	9,75 %	30.07.2024	674.197
600.000	America Movil SAB de CV	5,00 %	27.10.2026	639.279
645.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN	4,63 %	13.04.2027	637.443
620.000	Scottish Widows Ltd	5,50 %	16.06.2023	624.750

L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
3.500.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2028	2.940.802
1.900.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2024	1.830.337
1.813.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN'	4,87 %	06.05.2026	1.732.087
1.340.000	Scottish Widows Ltd	5,50 %	16.06.2023	1.340.970
1.090.000	Heathrow Funding Ltd 'REGS'	5,23 %	15.02.2023	1.088.919
1.000.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' FRN	3,47 %	26.04.2028	939.833
800.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,00 %	11.02.2023	794.488
730.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN'	4,88 %	31.07.2024	715.398
700.000	Banco Santander SA 'EMTN'	2,75 %	12.09.2023	693.881
700.000	UBS Group AG FRN	2,13 %	12.09.2025	659.327
640.000	HSBC Bank Plc 'EMTN'	6,50 %	07.07.2023	650.527
700.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN	1,50 %	03.12.2026	635.351
700.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,13 %	11.02.2027	621.402
600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,88 %	13.12.2022	597.951
570.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,50 %	23.01.2023	564.682
500.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	9,75 %	30.07.2024	547.821
600.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 'EMTN'	0,88 %	09.12.2025	519.945
480.000	Nationwide Building Society	1,00 %	24.01.2023	474.797
470.000	Northumbrian Water Finance Plc	6,88 %	06.02.2023	472.585
430.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	2,63 %	05.12.2022	429.698
460.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	0,74 %	29.10.2025	423.883
398.000	Mizuho Financial Group Inc 'EMTN'	5,63 %	13.06.2028	403.488
400.000	BPCE SA	2,13 %	16.12.2022	398.403
380.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN'	1,50 %	23.06.2023	374.682
370.000	Metropolitan Life Global Funding I 'EMTN'	2,88 %	11.01.2023	369.369
318.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN	8,41 %	14.11.2032	331.437
300.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN'	7,50 %	15.04.2024	309.855
320.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN'	2,50 %	10.10.2025	309.770
306.000	Protective Life Global Funding 'GMTN'	5,25 %	13.01.2028	308.633
300.000	Telefonica Emisiones SA 'EMTN'	5,29 %	09.12.2022	301.506
300.000	America Movil SAB de CV	5,00 %	27.10.2026	298.767
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	0,88 %	05.06.2023	296.900
300.000	New York Life Global Funding	1,63 %	15.12.2023	293.124

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten £
1.620.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2024	1.559.104
1.300.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN	1,67 %	02.06.2029	1.071.922
1.100.000	OP Corporate Bank plc 'GMTN'	1,38 %	04.09.2026	944.243
800.000	United Kingdom Gilt	4,50 %	07.12.2042	909.776
1.000.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 'EMTN' FRN	5,13 %	23.11.2052	873.249
711.000	Legal & General Finance Plc 'EMTN'	5,88 %	11.12.2031	846.341
1.100.000	United Kingdom Gilt	0,88 %	31.07.2033	843.738
860.000	Rothesay Life Plc FRN	5,50 %	17.09.2029	839.552
850.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN	3,13 %	22.06.2025	806.165
800.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' FRN	6,50 %	14.03.2029	794.024
720.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	6,75 %	16.11.2028	750.852
1.000.000	United Kingdom Gilt	1,00 %	31.01.2032	750.740
700.000	National Grid Electricity Distribution West Midlands Plc 'EMTN'	5,75 %	16.04.2032	723.730
900.000	Investec Plc 'EMTN' FRN	1,88 %	16.07.2028	722.432
800.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	2,38 %	14.03.2032	702.879
791.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	3,18 %	12.07.2029	684.962
684.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	5,00 %	24.01.2028	684.607
700.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN	6,13 %	12.12.2030	683.374
600.000	AT&T Inc 'EMTN'	7,00 %	30.04.2040	675.245
714.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'	3,63 %	10.03.2036	670.446

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
1.620.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2024	1.561.878
800.000	United Kingdom Gilt	4,50 %	07.12.2042	920.397
1.100.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN	1,67 %	02.06.2029	915.853
741.000	Legal & General Finance Plc 'EMTN'	5,88 %	11.12.2031	881.062
1.100.000	United Kingdom Gilt	0,88 %	31.07.2033	834.625
750.000	Bank of America Corp 'EMTN'	7,00 %	31.07.2028	806.921
700.000	SSE Plc 'EMTN'	8,38 %	20.11.2028	800.332
1.000.000	United Kingdom Gilt	1,00 %	31.01.2032	796.000
850.000	OP Corporate Bank plc 'GMTN'	1,38 %	04.09.2026	739.742
800.000	Barclays Plc FRN	3,75 %	22.11.2030	734.904
690.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	6,75 %	16.11.2028	729.304
700.000	Rothesay Life Plc FRN	5,50 %	17.09.2029	686.748
810.000	British Telecommunications Plc 'EMTN'	3,13 %	21.11.2031	686.566
700.000	Amgen Inc	4,00 %	13.09.2029	667.421

L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
750.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	3,18 %	12.07.2029	635.550
538.000	Deutsche Telekom International Finance BV	7,63 %	15.06.2030	624.359
670.000	AT&T Inc	2,90 %	04.12.2026	622.436
650.000	Phoenix Group Holdings Plc	5,87 %	13.06.2029	618.352
602.000	Scottish Widows Ltd	7,00 %	16.06.2043	614.114
600.000	AXA SA 'EMTN' FRN	5,63 %	16.01.2054	593.455

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
4.930.000	Kuwait International Government Bond 'REGS'	3,50 %	20.03.2027	4.835.138
4.100.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,25 %	02.06.2026	3.975.226
3.686.000	Hungary Government International Bond 'REGS'	6,13 %	22.05.2028	3.725.068
3.380.000	Oman Government International Bond 'REGS'	6,75 %	28.10.2027	3.518.374
3.568.000	Chile Government International Bond	3,24 %	06.02.2028	3.370.489
3.250.000	Kazakhstan Government International Bond 'REGS'	5,13 %	21.07.2025	3.355.552
3.203.000	Republic of Poland Government International Bond	4,00 %	22.01.2024	3.184.655
3.280.000	Republic of Poland Government International Bond	3,25 %	06.04.2026	3.172.299
3.180.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	3,13 %	11.10.2027	3.028.597
2.924.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	6,63 %	17.02.2028	2.998.726
2.900.000	Brazilian Government International Bond	4,25 %	07.01.2025	2.866.385
2.870.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	4,88 %	22.01.2024	2.862.441
2.827.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 'REGS'	6,13 %	04.12.2027	2.809.175
2.680.000	Dominican Republic International Bond 'REGS'	6,88 %	29.01.2026	2.717.421
10.585.000	Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon	0,75 %	09.07.2030	2.672.448
2.600.000	Southern Gas Corridor CJSC 'REGS'	6,88 %	24.03.2026	2.629.824
2.560.000	Hungary Government International Bond	5,38 %	25.03.2024	2.566.592
2.450.000	Brazilian Government International Bond	6,00 %	07.04.2026	2.530.786
2.550.000	Panama Government International Bond	3,88 %	17.03.2028	2.443.594
2.419.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	4,00 %	17.04.2025	2.394.913

L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
3.060.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	4,38 %	22.08.2023	3.049.401
1.800.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	0,75 %	02.09.2023	1.777.190
1.600.000	Croatia Government International Bond 'REGS'	5,50 %	04.04.2023	1.596.400
1.380.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,88 %	23.04.2023	1.377.367
1.370.000	Republic of Poland Government International Bond	3,00 %	17.03.2023	1.364.103
1.200.000	Oman Government International Bond 'REGS'	6,75 %	28.10.2027	1.265.013
1.215.000	Colombia Government International Bond	8,13 %	21.05.2024	1.258.469
1.260.000	Republic of Poland Government International Bond	4,00 %	22.01.2024	1.246.482
1.030.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	4,88 %	22.01.2024	1.026.104
900.000	Peruvian Government International Bond	7,35 %	21.07.2025	941.019
900.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	4,00 %	17.04.2025	888.674
850.000	Kuwait International Government Bond 'REGS'	3,50 %	20.03.2027	834.865
778.000	Brazilian Government International Bond	8,88 %	15.04.2024	808.271
800.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	4,75 %	24.04.2025	786.046
750.000	Mongolia Government International Bond 'REGS'	8,75 %	09.03.2024	745.462
800.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	4,75 %	19.04.2027	727.261
700.000	Colombia Government International Bond	4,00 %	26.02.2024	685.498
655.500	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais 'REGS'	5,33 %	15.02.2028	643.535
650.000	Republic of South Africa Government International Bond	4,67 %	17.01.2024	642.053
640.000	Morocco Government International Bond 'REGS'	4,25 %	11.12.2022	639.392
600.000	Jamaica Government International Bond	6,75 %	28.04.2028	635.700
616.000	Hungary Government International Bond	5,38 %	25.03.2024	619.294
550.000	Philippine Government International Bond	10,63 %	16.03.2025	615.485

L&G China CNY Bond UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
14.500.000	China Government Bond	2,60 %	01.09.2032	1.995.533
14.000.000	China Government Bond	2,80 %	15.11.2032	1.989.665
12.300.000	China Government Bond	2,69 %	15.08.2032	1.728.111
9.900.000	China Government Bond	2,88 %	25.02.2033	1.445.303
9.750.000	China Government Bond	2,62 %	25.09.2029	1.390.251
9.600.000	China Government Bond	2,75 %	15.06.2029	1.376.539
9.000.000	China Government Bond	2,64 %	15.01.2028	1.309.933
8.900.000	China Government Bond	2,50 %	25.07.2027	1.296.661
8.600.000	China Development Bank	2,69 %	16.06.2027	1.232.817
8.300.000	China Government Bond	2,79 %	15.12.2029	1.211.880
8.300.000	China Government Bond	2,24 %	25.05.2025	1.198.892
8.000.000	China Government Bond	2,76 %	15.05.2032	1.182.071
7.400.000	China Government Bond	2,46 %	15.02.2026	1.071.147
7.500.000	China Government Bond	2,44 %	15.10.2027	1.040.061
7.200.000	Agricultural Development Bank of China	2,50 %	24.08.2027	1.037.201
6.800.000	Agricultural Development Bank of China	3,48 %	04.02.2028	1.002.449
6.750.000	China Government Bond	2,18 %	25.08.2025	969.907
6.600.000	Agricultural Development Bank of China	2,97 %	14.10.2032	929.308
5.300.000	China Government Bond	3,01 %	13.05.2028	786.422
5.400.000	Agricultural Development Bank of China	3,10 %	27.02.2033	778.579
5.000.000	China Government Bond	3,77 %	08.03.2025	741.869
5.100.000	China Government Bond	2,80 %	25.03.2030	736.125
5.100.000	China Development Bank	2,77 %	24.10.2032	726.192
5.000.000	China Government Bond	2,91 %	14.10.2028	721.899
4.700.000	China Government Bond	2,67 %	25.05.2033	648.748
4.500.000	China Development Bank	3,02 %	06.03.2033	641.097
4.200.000	China Government Bond	2,48 %	15.04.2027	603.911
4.100.000	Agricultural Development Bank of China	3,06 %	06.06.2032	598.523
4.000.000	China Government Bond	3,02 %	22.10.2025	582.730
4.000.000	China Government Bond	2,26 %	24.02.2025	580.538
4.000.000	China Government Bond	2,62 %	15.04.2028	577.473
3.900.000	Agricultural Development Bank of China	3,58 %	22.04.2026	575.242
4.000.000	China Development Bank	2,96 %	18.07.2032	564.939
3.800.000	Agricultural Development Bank of China	3,83 %	06.01.2024	555.604
3.700.000	China Development Bank	2,98 %	22.04.2032	525.630
3.500.000	China Government Bond	2,47 %	02.09.2024	502.655
3.500.000	Agricultural Development Bank of China	2,96 %	17.04.2030	500.781

*Mit Wirkung vom 28. November 2022 wurde der Name des Fonds von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF geändert.

L&G China CNY Bond UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
28.500.000	China Government Bond	2,88 %	05.11.2023	4.089.467
23.300.000	China Government Bond	2,36 %	02.07.2023	3.281.829
21.000.000	China Government Bond	3,01 %	13.05.2028	3.117.026
20.000.000	China Government Bond	3,27 %	19.11.2030	2.957.841
18.200.000	China Government Bond	3,25 %	06.06.2026	2.638.609
17.200.000	China Government Bond	3,02 %	22.10.2025	2.506.130
17.000.000	China Government Bond	2,47 %	02.09.2024	2.485.250
16.600.000	China Government Bond	3,17 %	19.04.2023	2.430.336
16.500.000	China Government Bond	2,91 %	14.10.2028	2.396.403
16.300.000	China Government Bond	3,19 %	11.04.2024	2.350.329
15.700.000	China Government Bond	2,24 %	05.03.2023	2.329.946
13.900.000	China Government Bond	3,12 %	05.12.2026	2.057.240
14.000.000	China Government Bond	3,02 %	27.05.2031	2.039.814
13.800.000	China Government Bond	3,29 %	18.10.2023	2.016.263
14.000.000	China Government Bond	3,03 %	11.03.2026	2.006.328
13.600.000	China Government Bond	3,77 %	08.03.2025	1.987.535
13.000.000	China Government Bond	2,69 %	12.08.2026	1.865.134
12.800.000	China Government Bond	3,13 %	21.11.2029	1.857.059
12.900.000	Agricultural Development Bank of China	3,83 %	06.01.2024	1.841.473
12.300.000	China Government Bond	3,29 %	23.05.2029	1.825.595
12.500.000	China Government Bond	2,84 %	08.04.2024	1.794.213
12.500.000	Agricultural Development Bank of China	2,96 %	17.04.2030	1.783.839
12.000.000	China Government Bond	2,85 %	04.06.2027	1.738.839
11.600.000	Agricultural Development Bank of China	3,48 %	04.02.2028	1.702.092
11.800.000	China Government Bond	2,80 %	24.03.2029	1.689.605
10.500.000	Agricultural Development Bank of China	3,58 %	22.04.2026	1.546.266
10.500.000	China Government Bond	2,26 %	24.02.2025	1.536.607

*Mit Wirkung vom 28. November 2022 wurde der Name des Fonds von L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF in L&G China CNY Bond UCITS ETF geändert.

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
760.000	Bank of America Corp FRN	6,20 %	10.11.2028	780.967
740.000	ANZ Bank New Zealand Ltd '144A' FRN	5,55 %	11.08.2032	702.811
700.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A'	4,38 %	28.05.2030	610.320
700.000	Nationwide Building Society '144A' FRN	4,30 %	08.03.2029	609.620
650.000	Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust '144A'	4,13 %	01.02.2029	583.997
500.000	Roche Holdings Inc '144A'	7,00 %	01.03.2039	576.575
600.000	ABN AMRO Bank NV '144A'	4,80 %	18.04.2026	561.356
600.000	SC Johnson & Son Inc '144A'	4,80 %	01.09.2040	535.311
700.000	Centene Corp	2,63 %	01.08.2031	534.576
630.000	Zions Bancorp NA	3,25 %	29.10.2029	505.333
700.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN	3,73 %	14.01.2032	491.563
500.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN	4,70 %	22.03.2028	484.450
500.000	Discover Bank 'BKNT' FRN	4,68 %	09.08.2028	479.686
600.000	Sammons Financial Group Inc '144A'	3,35 %	16.04.2031	442.758
600.000	Fresenius Medical Care US Finance III Inc '144A'	2,38 %	16.02.2031	425.537
500.000	Northern Trust Corp	1,95 %	01.05.2030	409.781
500.000	Newcrest Finance Pty Ltd '144A'	3,25 %	13.05.2030	406.167
500.000	British Telecommunications Plc '144A'	3,25 %	08.11.2029	405.611
400.000	HSBC Holdings Plc FRN	6,25 %	09.03.2034	400.000
500.000	Aroundtown SA 'EMTN'	5,38 %	21.03.2029	388.673

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
540.000	ANZ Bank New Zealand Ltd '144A' FRN	5,55 %	11.08.2032	526.385
500.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN	4,70 %	22.03.2028	500.000
500.000	Danske Bank A/S '144A' FRN	1,23 %	22.06.2024	487.696
400.000	Roche Holdings Inc '144A'	7,00 %	01.03.2039	483.593
500.000	Nationwide Building Society '144A' FRN	4,30 %	08.03.2029	457.563
450.000	Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust '144A'	4,13 %	01.02.2029	409.050
400.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	3,79 %	21.05.2025	391.796
400.000	ABN AMRO Bank NV '144A'	4,80 %	18.04.2026	386.088
500.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN	3,73 %	14.01.2032	377.564
400.000	Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN	3,52 %	12.02.2030	375.252
400.000	KKR Group Finance Co II LLC '144A'	5,50 %	01.02.2043	373.715
400.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A'	4,38 %	28.05.2030	365.957
350.000	SC Johnson & Son Inc '144A'	4,80 %	01.09.2040	323.591
380.000	Zions Bancorp NA	3,25 %	29.10.2029	311.587

L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
350.000	Newcrest Finance Pty Ltd '144A'	3,25 %	13.05.2030	295.516
300.000	Mastercard Inc	3,35 %	26.03.2030	276.758
300.000	Northern Trust Corp	1,95 %	01.05.2030	252.108
250.000	National Australia Bank Ltd/New York	2,88 %	12.04.2023	250.000
300.000	Aroundtown SA 'EMTN'	5,38 %	21.03.2029	243.000
250.000	Credit Suisse AG/New York NY	1,00 %	05.05.2023	241.895

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
5.000.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN	6,30 %	09.01.2029	5.221.280
5.506.000	Prosus NV '144A'	3,68 %	21.01.2030	4.761.895
4.000.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	7,77 %	16.11.2028	4.412.790
5.000.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	2,68 %	29.06.2032	4.116.250
4.000.000	Standard Chartered Plc 'REGS' FRN	6,17 %	09.01.2027	4.105.000
4.000.000	SK Hynix Inc 'REGS'	6,50 %	17.01.2033	3.915.504
3.880.000	Ecopetrol SA	8,88 %	13.01.2033	3.833.709
3.800.000	TSMC Arizona Corp	4,50 %	22.04.2052	3.709.166
3.500.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 'REGS'	6,13 %	23.02.2038	3.514.700
3.870.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	2,61 %	12.01.2028	3.473.430
3.810.000	Prosus NV '144A'	3,26 %	19.01.2027	3.452.337
4.000.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	3,27 %	18.02.2036	3.285.160
3.000.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	7,78 %	16.11.2025	3.135.480
3.033.000	TSMC Arizona Corp	3,88 %	22.04.2027	3.028.581
3.010.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	6,38 %	24.10.2048	2.570.785
2.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN	5,86 %	14.09.2026	2.556.288
2.500.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 'REGS'	6,51 %	23.02.2042	2.543.750
3.050.000	TSMC Arizona Corp	3,25 %	25.10.2051	2.503.635
3.100.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS'	5,88 %	31.01.2050	2.462.675
2.400.000	OTP Bank Nyrt 'EMTN' FRN	8,75 %	15.05.2033	2.339.910

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
4.336.000	MAF Global Securities Ltd	4,75 %	07.05.2024	4.338.700
3.925.000	Ecopetrol SA	5,88 %	18.09.2023	3.936.706
3.700.000	TSMC Arizona Corp	4,50 %	22.04.2052	3.622.050
3.131.000	Perusahaan Gas Negara Tbk PT 'REGS'	5,13 %	16.05.2024	3.136.204
2.900.000	MAF Global Securities Ltd FRN	5,50 %	07.09.2170	2.907.250
3.650.000	TSMC Arizona Corp	3,25 %	25.10.2051	2.897.880
3.800.000	Seaspan Corp 'REGS'	5,50 %	01.08.2029	2.890.125
2.917.000	MTN Mauritius Investments Ltd 'REGS'	6,50 %	13.10.2026	2.871.931
2.833.000	TSMC Arizona Corp	3,88 %	22.04.2027	2.816.031
3.407.728	Sweihaan PV Power Co PJSC 'REGS'	3,63 %	31.01.2049	2.759.762
2.990.000	Shelf Drilling Holdings Ltd 'REGS'	8,25 %	15.02.2025	2.713.364
2.657.000	Bharti Airtel International Netherlands BV 'REGS'	5,35 %	20.05.2024	2.712.797
3.420.633	MC Brazil Downstream Trading SARL 'REGS'	7,25 %	30.06.2031	2.666.323
3.100.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd/The 'EMTN'	2,25 %	15.07.2031	2.572.967

L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
2.400.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN	7,77 %	16.11.2028	2.552.864
2.850.000	Prudential Funding Asia Plc 'EMTN' FRN	2,95 %	03.11.2033	2.449.868
2.500.000	Siam Commercial Bank PCL/Cayman Islands 'GMTN'	4,40 %	11.02.2029	2.425.761
2.750.000	Energean Israel Finance Ltd '144A'	5,38 %	30.03.2028	2.391.275
2.400.000	Oztel Holdings SPC Ltd 'REGS'	5,63 %	24.10.2023	2.386.625
2.500.000	Banco Santander Chile 'REGS'	2,70 %	10.01.2025	2.353.805

L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
4.046.604	Uniper SE	22.202.180
8.026.110	FuelCell Energy Inc	19.451.980
3.214.924	Ballard Power Systems Inc	16.972.231
1.699.559	Plug Power Inc	16.813.166
10.798.901	ITM Power Plc	12.376.264
441.685	Doosan Fuel Cell Co Ltd	11.263.298
652.176	Bloom Energy Corp - Class A	11.212.918
666.388	Siemens Energy AG	10.830.071
340.074	Chemours Co/The	10.624.872
635.651	Toyota Motor Corp	9.095.500
37.039	Cummins Inc	8.460.124
371.692	Industrie De Nora SpA	7.663.121
79.818	Orsted AS '144A'	7.366.724
24.974	Air Products and Chemicals Inc	7.073.118
278.585	Johnson Matthey Plc	6.888.733
4.804.886	Weichai Power Co Ltd 'H'	6.293.043
365.312	Nippon Sanso Holdings Corp	6.089.865
44.888	Hyundai Motor Co	5.908.266
3.819.897	NEL ASA	5.563.904
100.799	Kyocera Corp	5.210.534
34.840	Air Liquide SA	5.013.327
13.806	Linde Plc/old	4.370.894
376.312	PowerCell Sweden AB	4.170.176
563.626	Ceres Power Holdings Plc	2.980.434
3.488.930	Aker Horizons ASA	2.900.140
80.033	Kolon Industries Inc	2.854.276
1.336.908	Hyzon Motors Inc	2.409.692

L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
861.138	Siemens Energy AG	21.879.036
4.997.145	Uniper SE	20.379.235
610.485	Bloom Energy Corp - Class A	12.815.115
40.149	Cummins Inc	9.921.153
33.724	Air Products and Chemicals Inc	9.904.569
783.014	PowerCell Sweden AB	8.952.674
6.434.365	NEL ASA	8.882.768
10.123.251	ITM Power Plc	8.854.283
1.769.135	Ceres Power Holdings Plc	7.399.079
4.527.346	Weichai Power Co Ltd 'H'	6.664.295
39.068	Air Liquide SA	6.475.197
170.375	Kolon Industries Inc	5.813.176
545.875	McPhy Energy SA	5.694.138
15.860	Linde Plc/old	5.209.374
29.639	Hyundai Motor Co	4.421.135
170.200	Nippon Sanso Holdings Corp	3.321.975
128.801	SFC Energy AG	2.944.003
12.304.280	AFC Energy Plc	2.751.722
2.967.301	Hyzon Motors Inc	2.328.528
381.413	Ballard Power Systems Inc	2.273.671
39.900	Kyocera Corp	2.073.787
4.621	Linde Plc	1.714.060

L&G ESG Green Bond UCITS ETF***Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten €
100.000	Eurofima Europaeische Gesellschaft	0,01 %	23.06.2028	92.547
100.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2030	92.151
89.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4,00 %	30.04.2035	86.123
100.000	ESB Finance DAC	1,13 %	11.06.2030	85.959
100.000	ESB Finance DAC	1,00 %	19.07.2034	77.150
80.000	Bundesobligation	0,00 %	10.10.2025	76.163
61.000	Republic of Austria Government Bond	1,85 %	23.05.2049	62.699
100.000	United Kingdom Gilt	1,50 %	31.07.2053	62.395
55.000	Bundesobligation	1,30 %	15.10.2027	53.207
50.000	Kingdom of Belgium Government Bond	2,75 %	22.04.2039	50.020
54.000	French Republic Government Bond OAT '144A'	1,75 %	25.06.2039	48.111
55.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc	3,40 %	01.05.2030	47.221
40.000	European Union	2,63 %	04.02.2048	46.334
40.000	United Kingdom Gilt	0,88 %	31.07.2033	35.603
30.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG	4,05 %	22.11.2029	30.239
30.000	European Investment Bank 'EMTN'	3,75 %	14.02.2033	27.683
20.000	European Investment Bank 'EMTN'	0,75 %	15.11.2024	21.774
20.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc	5,00 %	15.01.2033	19.267
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2031	8.496
10.000	EWE AG	0,25 %	08.06.2028	8.458

*Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

L&G ESG Green Bond UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse €
540.000	French Republic Government Bond OAT '144A'	1,75 %	25.06.2039	446.908
240.000	MTR Corp CI Ltd	2,50 %	02.11.2026	214.735
205.000	United Kingdom Gilt	0,88 %	31.07.2033	177.609
251.000	Netherlands Government Bond '144A'	0,50 %	15.01.2040	174.831
240.000	European Union	0,40 %	04.02.2037	164.886
194.000	Greenko Dutch BV 'REGS'	3,85 %	29.03.2026	159.672
200.000	Hong Kong Government International Bond 'REGS'	1,38 %	02.02.2031	153.016
150.000	TenneT Holding BV FRN (Perpetual)	3,00 %	01.06.2172	148.733
167.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A'	1,25 %	22.04.2033	142.912
236.000	French Republic Government Bond OAT '144A'	0,50 %	25.06.2044	138.174
216.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A'	1,50 %	30.04.2045	128.864
200.000	United Kingdom Gilt	1,50 %	31.07.2053	128.471
138.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2030	117.444
138.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2031	114.159
100.000	Ellaktor Value Plc 'REGS'	6,38 %	15.12.2024	101.000
100.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual)	1,88 %	22.05.2171	100.000
109.000	Ireland Government Bond	1,35 %	18.03.2031	98.856
100.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	0,88 %	22.04.2025	95.060
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN'	0,75 %	04.12.2024	94.971
100.000	Covivio	1,88 %	20.05.2026	94.275
100.000	Adif Alta Velocidad 'EMTN'	1,25 %	04.05.2026	94.221
100.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN	1,13 %	07.12.2028	93.952
100.000	Digital Euro Finco LLC	2,50 %	16.01.2026	93.674
100.000	Enel Finance International NV 'EMTN'	1,13 %	16.09.2026	93.001
100.000	EDP - Energias de Portugal SA 'EMTN'	1,63 %	15.04.2027	92.675
100.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 'EMTN'	1,13 %	09.07.2026	92.375
100.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN	0,38 %	18.11.2026	90.365
100.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN	0,38 %	16.06.2027	89.863
100.000	TenneT Holding BV 'EMTN'	1,38 %	26.06.2029	89.696
100.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,13 %	23.06.2027	89.396
100.000	National Grid Plc 'EMTN'	0,25 %	01.09.2028	88.565
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN	1,88 %	02.08.2081	88.170
100.000	CTP NV 'EMTN'	0,50 %	21.06.2025	88.097
100.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN	2,88 %	30.05.2031	87.543
100.000	Engie SA 'EMTN'	2,13 %	30.03.2032	87.456
100.000	Hong Kong Government International Bond 'GMTN'	0,00 %	24.11.2026	87.242

*Der Fonds wurde am 19. Mai 2023 geschlossen.

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
47.620	Woori Financial Group Inc	408.009
48.000	Swire Pacific Ltd	370.712
396.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	362.614
16.871	Ampol Ltd	342.403
240.695	Nine Entertainment Co Holdings Ltd	332.427
15.335	Woodside Energy Group Ltd	329.253
113.674	Fletcher Building Ltd	310.815
8.850	GS Holdings Corp	291.827
33.031	LG Uplus Corp	272.878
5.872	Korea Investment Holdings Co Ltd	236.546
514.630	Keppel Infrastructure Trust	206.125
2.736	Rio Tinto Ltd	195.854
5.934	Hana Financial Group Inc	185.894
85.000	SITC International Holdings Co Ltd	184.569
40.844	Atlas Arteria Ltd	172.546
1.453	Macquarie Group Ltd	170.561
137.500	Swire Pacific Ltd	169.561
162.000	Lenovo Group Ltd	141.628
6.143	Sonic Healthcare Ltd	139.390
3.802	KB Financial Group Inc	139.032
79.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	137.929
54.229	Aurizon Holdings Ltd	124.286
22.500	CK Infrastructure Holdings Ltd	123.829
4.298	JB Hi-Fi Ltd	119.865
166.000	Want Want China Holdings Ltd	111.846
308.780	First Pacific Co Ltd	110.722
2.380	ASX Ltd	107.983
677	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	107.469
5.100	United Overseas Bank Ltd	105.366
19.000	Power Assets Holdings Ltd	103.975
3.709	Shinhan Financial Group Co Ltd	98.435
28.961	Spark New Zealand Ltd	96.835
9.522	McMillan Shakespeare Ltd	92.943
98.576	HKBN Ltd	91.727
18.679	Contact Energy Ltd	91.662

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
120.488	Atlas Arteria Ltd	530.269
55.008	CK Hutchison Holdings Ltd	339.960
519.000	Want Want China Holdings Ltd	338.030
7.362	Samsung Life Insurance Co Ltd	336.447
102.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	328.960
8.215	Meritz Fire & Marine Insurance Co Ltd	326.732
14.203	EBOS Group Ltd	323.550
19.900	Hang Seng Bank Ltd	307.617
531.500	WH Group Ltd '144A'	306.923
168.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	291.009
7.788	SK Telecom Co Ltd	288.249
5.244	Mineral Resources Ltd	249.186
51.757	Meritz Securities Co Ltd	244.656
246.640	Alumina Ltd	234.778
2.052	Rio Tinto Ltd	152.259
1.246	Macquarie Group Ltd	142.275
158.000	Uni-President China Holdings Ltd	126.194
99.590	Centuria Capital Group	121.505
65.082	Genesis Energy Ltd	116.855
3.818	Hana Financial Group Inc	116.398
20.220	GUD Holdings Ltd	113.045
708	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	111.057
29.524	Tassal Group Ltd	99.706
93.829	Olam Group Ltd	96.816
9.900	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	88.425
27.462	Spark New Zealand Ltd	87.222
6.429	Fortescue Metals Group Ltd	84.842

L&G Digital Payments UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
142.271	Payoneer Global Inc	755.287
14.272	Kakaopay Corp	700.896
74.395	Expensify Inc	653.530
53.358	Remitly Global Inc	622.080
8.830	Shift4 Payments Inc - Class A	567.826
97.056	Marqeta Inc	538.630
8.452	Fidelity National Information Services Inc	538.047
34.170	Lightspeed Commerce Inc	535.545
72.850	Repay Holdings Corp - Class A	521.600
66.010	Wise Plc - Class A	499.319
32.116	Dlocal Ltd/Uruguay - Class A	482.903
6.537	PayPal Holdings Inc	473.472
16.888	Q2 Holdings Inc	451.958
24.133	Green Dot Corp - Class A	439.238
13.470	Nuvei Corp '144A'	424.216
6.550	Block Inc	416.869
3.813	Global Payments Inc	404.128
4.883	GMO Payment Gateway Inc	390.235
16.569	ACI Worldwide Inc	385.561
46.558	Nexi SpA '144A'	385.424
9.081	Worldline SA/France '144A'	382.958
138.400	Yeahka Ltd	382.552
15.450	Flywire Corp	372.374
3.877	Euronet Worldwide Inc	372.320
37.275	Pagseguro Digital Ltd - Class A	372.044
3.499	Discover Financial Services	363.388
14.526	International Money Express Inc	362.738
15.710	I3 Verticals Inc - Class A	361.389
633	Fair Isaac Corp	360.393
2.214	American Express Co	348.226
45.067	Zuora Inc	342.093
8.522	Shopify Inc - Class A	339.312
90.773	Network International Holdings Plc '144A'	333.389
34.687	BTRS Holdings Inc	327.088
391.945	Pushpay Holdings Ltd	309.426
2.941	Fiserv Inc	308.923
205	Adyen NV '144A'	307.994
5.661	Edenred	306.992

L&G Digital Payments UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
1.442	Visa Inc - Class A	306.703
22.683	OneSpan Inc	303.585
30.551	StoneCo Ltd - Class A	298.512
855	Mastercard Inc	290.938
23.600	Credit Saison Co Ltd	282.041
6.953	Evo Payments Inc	232.856
28.913	Paya Holdings Inc	231.810
600.602	Zip Co Ltd	204.608

L&G Digital Payments UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
96.747	BTRS Holdings Inc	909.080
79.105	Paya Holdings Inc	731.290
29.250	International Money Express Inc	707.160
5.893	Fiserv Inc	682.383
19.392	Evo Payments Inc	652.322
705.497	Pushpay Holdings Ltd	628.323
7.441	Coupa Software Inc	601.207
10.249	Tencent Holdings Ltd	428.124
635	Fair Isaac Corp	424.938
7.561	Shopify Inc - Class A	417.922
21.137	Remitly Global Inc	403.570
48.326	Wise Plc - Class A	366.826
12.615	Flywire Corp	353.709
70.459	Network International Holdings Plc '144A'	275.074
21.330	Zuora Inc	236.319
18.760	StoneCo Ltd - Class A	218.475
437.451	EML Payments Ltd	190.788
2.746	Edenred	166.041
1.369	Euronet Worldwide Inc	152.596
2.899	Worldline SA/France '144A'	121.855
11.905	Pageseguro Digital Ltd - Class A	121.025
7.252	OneSpan Inc	103.986

L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
1.607.252.955	Barclays Bank Plc	5,43 %	24.07.2023	1.607.252.955
1.583.979.955	Barclays Bank Plc	5,18 %	24.05.2023	1.583.979.955
1.551.076.955	Barclays Bank Plc	4,93 %	22.03.2023	1.551.076.955
1.542.832.955	Barclays Bank Plc	5,44 %	24.07.2023	1.542.832.955
1.533.054.955	Barclays Bank Plc	5,43 %	22.06.2023	1.533.054.955
1.524.699.955	Barclays Bank Plc	5,19 %	24.05.2023	1.524.699.955
1.499.537.955	Barclays Bank Plc	4,93 %	24.04.2023	1.499.537.955
1.493.921.955	Barclays Bank Plc	4,93 %	22.03.2023	1.493.921.955
1.428.841.955	Barclays Bank Plc	4,93 %	22.03.2023	1.428.841.955
1.365.546.955	Barclays Bank Plc	4,68 %	22.02.2023	1.365.546.955
1.284.899.955	Barclays Bank Plc	2,64 %	24.10.2022	1.284.899.955
1.275.625.955	Barclays Bank Plc	4,68 %	24.01.2023	1.275.625.955
1.273.831.955	Barclays Bank Plc	4,18 %	22.12.2022	1.273.831.955
1.260.448.955	Barclays Bank Plc	3,41 %	23.11.2022	1.260.448.955
1.222.366.955	Barclays Bank Plc	4,18 %	22.12.2022	1.222.366.955
1.181.979.955	Barclays Bank Plc	2,64 %	24.10.2022	1.181.979.955
876.408.955	Barclays Bank Plc	2,66 %	22.09.2022	876.408.955
836.433.955	Barclays Bank Plc	2,66 %	22.09.2022	836.433.955
824.888.955	Barclays Bank Plc	1,92 %	24.08.2022	824.888.955
799.713.955	Barclays Bank Plc	2,66 %	22.09.2022	799.713.955
783.693.955	Barclays Bank Plc	1,92 %	24.08.2022	783.693.955
775.154.955	Barclays Bank Plc	1,92 %	22.07.2022	775.154.955
742.062.955	Barclays Bank Plc	1,69 %	22.07.2022	742.062.955
317.544.000	Barclays Bank Plc	2,65 %	22.09.2022	317.544.000

L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
1.607.252.955	Barclays Bank Plc	5,43 %	24.07.2023	1.607.252.955
1.583.979.955	Barclays Bank Plc	5,18 %	24.05.2023	1.583.979.955
1.551.076.955	Barclays Bank Plc	4,93 %	22.03.2023	1.551.076.955
1.533.054.955	Barclays Bank Plc	5,43 %	22.06.2023	1.533.054.955
1.524.699.955	Barclays Bank Plc	5,19 %	24.05.2023	1.524.699.955
1.499.537.955	Barclays Bank Plc	4,93 %	24.04.2023	1.499.537.955
1.493.921.955	Barclays Bank Plc	4,93 %	22.03.2023	1.493.921.955
1.428.841.955	Barclays Bank Plc	4,93 %	22.03.2023	1.428.841.955
1.365.546.955	Barclays Bank Plc	4,68 %	22.02.2023	1.365.546.955
1.284.899.955	Barclays Bank Plc	2,64 %	24.10.2022	1.284.899.955
1.275.625.955	Barclays Bank Plc	4,68 %	24.01.2023	1.275.625.955
1.273.831.955	Barclays Bank Plc	4,18 %	22.12.2022	1.273.831.955
1.260.448.955	Barclays Bank Plc	3,41 %	23.11.2022	1.260.448.955
1.222.366.955	Barclays Bank Plc	4,18 %	22.12.2022	1.222.366.955
1.181.979.955	Barclays Bank Plc	2,64 %	24.10.2022	1.181.979.955
876.408.955	Barclays Bank Plc	2,66 %	22.09.2022	876.408.954
836.433.955	Barclays Bank Plc	2,66 %	22.09.2022	836.433.955
824.888.955	Barclays Bank Plc	1,92 %	24.08.2022	824.888.955
799.713.955	Barclays Bank Plc	2,66 %	22.09.2022	799.713.955
795.902.955	Barclays Bank Plc	1,69 %	22.07.2022	795.902.955
783.693.955	Barclays Bank Plc	1,92 %	24.08.2022	783.693.955
775.154.955	Barclays Bank Plc	1,92 %	22.07.2022	775.154.955
742.062.955	Barclays Bank Plc	1,69 %	22.07.2022	742.062.955
317.544.000	Barclays Bank Plc	2,65 %	22.09.2022	317.544.000

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
50.610	EDP - Energias do Brasil SA	214.760
54.799	Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp	112.919
776.746	OMV Petrom SA	72.056
62.000	Uni-President China Holdings Ltd	66.383
36.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	66.064
69.909	China Steel Corp	65.534
11.266	Cleanaway Co Ltd	65.128
147.291	China Everbright Environment Group Ltd	64.281
9.295	Bancolombia SA - Preference	64.090
43.414	China Gas Holdings Ltd	63.156
127.200	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A'	63.035
49.618	TA Chen Stainless Pipe	61.807
12.715	Al Meera Consumer Goods Co QSC	61.793
36.200	Petronas Chemicals Group Bhd	58.478
11.700	China Merchants Bank 'A'	58.435
5.390	Banque Saudi Fransi	57.317
13.000	Unimicron Technology Corp	57.062
41.659	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	56.563
174.900	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	55.922
15.390	International Container Terminal Services Inc	55.759

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
41.100	EDP - Energias do Brasil SA	180.484
4.000	Delta Electronics Thailand PCL	95.262
4.800	International Games System Co Ltd	87.715
240.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	79.364
18.616	ITC Ltd	77.208
164.325	Innolux Corp	75.820
28.400	Universal Robina Corp	73.175
33.269	Metalurgica Gerdau SA - Preference	71.675
13.000	Catcher Technology Co Ltd	71.351
13.633	Qatar Electricity & Water Co QSC	70.805
26.596	Kuwait Finance House KSCP	69.226
29.000	Far EastTone Telecommunications Co Ltd	67.932
13.000	Sino-American Silicon Products Inc	66.034
11.600	Banco Santander Brasil SA	64.734
10.900	Itau Unibanco Holding SA - Preference	60.648
36.000	Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp	58.411
63.798	Goldsun Building Materials Co Ltd	57.560
101.094	AUO Corp	57.529
72.955	Petkim Petrokimya Holding AS	57.416
57.625	Qisda Corp	57.066
4.000	Novatek Microelectronics Corp	56.715
36.000	WPG Holdings Ltd	56.506
12.500	Hengan International Group Co Ltd	56.041
43.384	REC Ltd	55.479
42.088	PTT Global Chemical PCL	54.390
1.162	Bajaj Auto Ltd	53.685
17.370	Sanlam Ltd	52.560
71.000	Inventec Corp	52.339

L&G India INR Government Bond UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
2.680.000.000	India Government Bond	7,38 %	20.06.2027	33.337.807
2.377.000.000	India Government Bond	7,10 %	18.04.2029	29.412.395
2.300.000.000	India Government Bond	7,54 %	23.05.2036	28.769.905
2.181.000.000	India Government Bond	7,26 %	22.08.2032	26.376.805
1.967.000.000	India Government Bond	7,36 %	12.09.2052	23.833.650
1.195.000.000	India Government Bond	7,41 %	19.12.2036	14.675.083
1.094.000.000	India Government Bond	7,26 %	06.02.2033	13.409.678
898.000.000	India Government Bond	6,54 %	17.01.2032	10.652.255
777.000.000	India Government Bond	6,99 %	15.12.2051	9.116.643
479.000.000	India Government Bond	5,63 %	12.04.2026	5.643.227
375.000.000	India Government Bond	5,77 %	03.08.2030	4.204.545
332.000.000	India Government Bond	7,06 %	10.04.2028	4.043.816
335.000.000	India Government Bond	5,22 %	15.06.2025	3.952.555
322.000.000	India Government Bond	6,18 %	04.11.2024	3.892.777
295.000.000	India Government Bond	5,15 %	09.11.2025	3.446.786
279.000.000	India Government Bond	7,17 %	17.04.2030	3.416.565
225.000.000	India Government Bond	7,72 %	15.06.2049	2.861.424
230.000.000	India Government Bond	7,16 %	20.09.2050	2.711.866
230.000.000	India Government Bond	6,10 %	12.07.2031	2.583.827
220.000.000	India Government Bond	5,74 %	15.11.2026	2.557.445

L&G India INR Government Bond UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
1.181.000.000	India Government Bond	7,38 %	20.06.2027	14.687.850
933.200.000	India Government Bond	7,32 %	28.01.2024	11.430.938
746.200.000	India Government Bond	6,18 %	04.11.2024	9.047.866
752.300.000	India Government Bond	5,63 %	12.04.2026	8.848.441
733.000.000	India Government Bond	7,26 %	22.08.2032	8.831.059
705.400.000	India Government Bond	7,10 %	18.04.2029	8.803.852
540.000.000	India Government Bond	7,54 %	23.05.2036	6.811.663
608.500.000	India Government Bond	5,77 %	03.08.2030	6.576.132
538.000.000	India Government Bond	7,36 %	12.09.2052	6.498.394
565.700.000	India Government Bond	6,10 %	12.07.2031	6.440.130
514.400.000	India Government Bond	5,22 %	15.06.2025	6.078.138
447.600.000	India Government Bond	7,16 %	20.09.2050	5.325.711
375.000.000	India Government Bond	7,72 %	15.06.2049	4.713.407
385.200.000	India Government Bond	6,45 %	07.10.2029	4.520.863
380.900.000	India Government Bond	5,15 %	09.11.2025	4.449.141
326.100.000	India Government Bond	5,85 %	01.12.2030	3.610.279
302.700.000	India Government Bond	5,79 %	11.05.2030	3.384.157
281.000.000	India Government Bond	5,74 %	15.11.2026	3.319.702
283.000.000	India Government Bond	6,67 %	17.12.2050	3.157.742
229.000.000	India Government Bond	7,26 %	14.01.2029	2.768.779
152.000.000	India Government Bond	6,54 %	17.01.2032	1.730.520

L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
18.762	Luminar Technologies Inc - Class A	155.278
14.218	Nikon Corp	151.056
11.175	Topcon Corp	148.742
2.964	Horiba Ltd	148.706
18.331	Luna Innovations Inc	142.068
4.987	AIXTRON SE	140.005
1.237	Fabrinet	138.996
905	Lasertec Corp	137.988
1.277	IPG Photonics Corp	137.788
64.893	Desktop Metal Inc	137.267
7.345	Olympus Corp	135.926
3.969	Corning Inc	135.347
9.073	Stratasys Ltd	134.803
191	Bystronic AG	134.251
4.828	Gentex Corp	134.087
11.007	Ushio Inc	133.108
10.957	nLight Inc	131.265
2.874	Renishaw Plc	131.018
2.823	Hamamatsu Photonics KK	130.759
2.114	Lumentum Holdings Inc	130.628
11.987	Hexagon AB	128.979
4.677	FARO Technologies Inc	128.473
8.765	Ei.En. SpA	127.947
4.100	Signify NV '144A'	127.822
310	Keyence Corp	126.686
2.699	Cognex Corp	126.639
876	Novanta Inc	125.897
1.237	Hoya Corp	125.686
9.982	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	124.491
219	ASML Holding NV	123.242
1.265	MKS Instruments Inc	121.318
22.663	Vuzix Corp	119.866
941	Carl Zeiss Meditec AG	118.756
3.236	Jenoptik AG	111.234
14.805	ams-OSRAM AG	109.049
14.845	Lightwave Logic Inc	86.244
57.500	Everlight Electronics Co Ltd	73.067
2.400	Koito Manufacturing Co Ltd	65.940
54.360	Velodyne Lidar Inc	62.312
6.767	LPKF Laser & Electronics SE	60.877

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
6.767	LPKF Laser & Electronics SE	82.834
57.500	Everlight Electronics Co Ltd	70.658
4.000	Koito Manufacturing Co Ltd	64.562
7.039	Luna Innovations Inc	58.799
439	Fabrinet	57.615
288	Lasertec Corp	52.421
1.455	AIXTRON SE	48.319
1.285	Signify NV '144A'	45.121
67	ASML Holding NV	42.377
818	Hamamatsu Photonics KK	42.375
801	Cognex Corp	40.954
2.454	Ei.En. SpA	38.166
4.816	ams-OSRAM AG	38.119
242	Novanta Inc	37.110
2.846	Ushio Inc	36.763
4.905	Luminar Technologies Inc - Class A	36.489
51	Bystronic AG	36.328
3.072	Hexagon AB	36.306
1.316	Gentex Corp	36.093
85	Keyence Corp	35.666
356	IPG Photonics Corp	34.847
1.723	Olympus Corp	33.987
999	Corning Inc	33.952
252	Carl Zeiss Meditec AG	33.456
702	Renishaw Plc	32.943
1.018	FARO Technologies Inc	32.826
700	Horiba Ltd	32.261
2.786	nLight Inc	31.060
300	Hoya Corp	30.659
2.600	Topcon Corp	30.639
28.471	Velodyne Lidar Inc	29.891
2.560	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	29.660
21.239	Ouster Inc	28.881
3.100	Nikon Corp	28.436
294	MKS Instruments Inc	25.590
15.060	Desktop Metal Inc	24.846
1.901	Stratasys Ltd	23.684
400	Lumentum Holdings Inc	22.153
4.203	Vuzix Corp	16.600

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF***Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
220	SolarEdge Technologies Inc	64.919
301	Tesla Inc	63.531
4.948	Sumitomo Electric Industries Ltd	59.356
1.891	BYD Co Ltd 'H'	57.693
6.038	Delta Electronics Inc	56.960
1.318	Renault SA	48.920
237	Alnylam Pharmaceuticals Inc	47.848
979	Mineral Resources Ltd	47.642
153	Vertex Pharmaceuticals Inc	46.808
16.473	Pilbara Minerals Ltd	45.134
539	EnerSys	43.921
448	BioMarin Pharmaceutical Inc	42.548
579	Incyte Corp	41.438
107	Genmab A/S	41.206
805	PTC Therapeutics Inc	40.849
418	Bayerische Motoren Werke AG	40.153
103	LG Energy Solution Ltd	40.085
565	Mercedes-Benz Group AG	39.538
80	Samsung SDI Co Ltd	39.105
1.781	Kyowa Kirin Co Ltd	38.777

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
4.579	CTI BioPharma Corp	41.581
147	CSL Ltd	29.390
9.967	Pilbara Minerals Ltd	29.353
304	Novartis AG ADR	29.065
261	Sanofi	28.069
537	Mineral Resources Ltd	27.634
249	Horizon Therapeutics Plc	27.336
142	Seagen Inc	26.008
156	AbbVie Inc	25.443
680	AMG Critical Materials NV	25.322
80	SolarEdge Technologies Inc	24.967
2.297	Grifols SA	24.382
2.532	Delta Electronics Inc	24.218
642	Supernus Pharmaceuticals Inc	24.210

L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
42.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	24.029
640	Renault SA	23.001
763	BYD Co Ltd 'H'	22.915
1.900	Sumitomo Electric Industries Ltd	22.667
1.856	Amicus Therapeutics Inc	21.743
101	Alnylam Pharmaceuticals Inc	21.511

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
1.731	Advanced Micro Devices Inc	160.342
827	Meta Platforms Inc - Class A	160.192
778	NVIDIA Corp	154.658
548	Microsoft Corp	154.173
264	Broadcom Inc	153.139
382	Adobe Inc	151.599
3.131	Samsung Electronics Co Ltd	144.221
1.106	QUALCOMM Inc	141.120
8.349	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	139.154
2.081	Micron Technology Inc	124.828
175	Equinix Inc (REIT)	119.833
296	Palo Alto Networks Inc	111.686
413	Autodesk Inc	84.910
1.627	Marvell Technology Inc	81.134
1.021	Block Inc	69.684
1.226	Fortinet Inc	66.969
489	Arista Networks Inc	63.134
2.781	MediaTek Inc	61.988
340	Keysight Technologies Inc	55.828
383	Baidu Inc ADR	55.341
1.382	Dassault Systemes SE	54.144
430	VMware Inc	52.118
10.416	Nokia Oyj	49.497
273	NAVER Corp	46.210
167	ANSYS Inc	44.810
5.994	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	40.119
3.439	Hexagon AB	39.986
2.434	Hewlett Packard Enterprise Co	34.794
888	ROBLOX Corp	34.623
546	Cloudflare Inc	33.807

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
288	NVIDIA Corp	78.500
383	Baidu Inc ADR	55.268
81	Broadcom Inc	53.427
212	Meta Platforms Inc - Class A	47.797
941	Samsung Electronics Co Ltd	47.192
416	Advanced Micro Devices Inc	44.757
133	Microsoft Corp	40.308
2.254	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	39.327
91	Adobe Inc	35.385
532	Micron Technology Inc	35.213
267	QUALCOMM Inc	31.096
43	Equinix Inc (REIT)	30.737
141	Palo Alto Networks Inc	26.522
105	Autodesk Inc	21.837
412	Marvell Technology Inc	19.925
307	Fortinet Inc	18.865
120	Arista Networks Inc	17.635
255	Block Inc	17.555
357	Dassault Systemes SE	14.938
85	Keysight Technologies Inc	14.309
109	VMware Inc	13.626
512	MediaTek Inc	12.814
43	ANSYS Inc	12.644
72	NAVER Corp	11.765
2.726	Nokia Oyj	11.651
600	Hewlett Packard Enterprise Co	9.230
230	ROBLOX Corp	9.002
1.615	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	8.716

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Die Fonds wurden am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
5.228	Fortinet Inc	291.216
1.420	Palo Alto Networks Inc	289.825
2.193	Qualys Inc	285.894
23.475	OneSpan Inc	285.168
2.198	Arista Networks Inc	282.381
27.459	Renesas Electronics Corp	280.028
1.977	CyberArk Software Ltd	277.918
70.186	Darktrace Plc	276.418
2.269	Check Point Software Technologies Ltd	274.532
5.127	Trend Micro Inc/Japan	265.520
17.592	A10 Networks Inc	263.290
491	Broadcom Inc	260.207
8.185	NetScout Systems Inc	258.675
23.965	Fastly Inc	257.033
1.817	CrowdStrike Holdings Inc	256.269
4.697	Cloudflare Inc	256.009
11.693	Radware Ltd	251.658
6.561	STMicroelectronics NV	251.342
42.034	Telos Corp	249.397
6.319	Dell Technologies Inc	248.222
27.909	SolarWinds Corp	247.172
6.498	Dynatrace Inc	244.879
1.662	F5 Inc	243.510
6.511	Tenable Holdings Inc	239.410
1.483	NXP Semiconductors NV	238.647
1.801	Zscaler Inc	233.274
2.811	Advanced Micro Devices Inc	217.086
4.498	Rapid7 Inc	210.301
21.889	Identiv Inc	208.634
3.532	eMemory Technology Inc	199.056
12.489	SentinelOne Inc	198.874
61.542	Rackspace Technology Inc	187.035
2.912	Okta Inc	187.029
35.678	IonQ Inc	186.964
4.934	Infineon Technologies AG	184.118
53.701	Elan Microelectronics Corp	177.827
18.391	Mitek Systems Inc	175.031
43.104	GB Group Plc	173.409
224.441	Fingerprint Cards AB - Class B	107.188

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
10.886	OneSpan Inc	148.776
2.897	STMicroelectronics NV	135.011
10.300	Renesas Electronics Corp	126.434
808	Arista Networks Inc	111.037
2.613	Dynatrace Inc	109.290
7.762	Fastly Inc	109.076
184	Broadcom Inc	108.079
840	Check Point Software Technologies Ltd	105.576
1.767	Fortinet Inc	105.531
721	CyberArk Software Ltd	105.122
6.215	A10 Networks Inc	96.395
523	NXP Semiconductors NV	94.955
2.276	Tenable Holdings Inc	94.844
1.609	Cloudflare Inc	93.997
10.622	SolarWinds Corp	93.833
524	Palo Alto Networks Inc	90.619
1.977	Dell Technologies Inc	85.445
701	Qualys Inc	83.098
280.241	Fingerprint Cards AB - Class B	81.375
2.430	NetScout Systems Inc	75.906
3.409	Radware Ltd	70.082
458	F5 Inc	66.548
2.249	Ping Identity Holding Corp	64.056
1.300	Trend Micro Inc/Japan	62.906
442	Zscaler Inc	56.409
679	Advanced Micro Devices Inc	54.910
544	Okta Inc	37.394
831	Rapid7 Inc	35.150
7.867	Darktrace Plc	31.433
202	Crowdstrike Holdings Inc	27.247

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 29. Juli 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. September 2022 aufgelegt.

L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
34.000	AIA Group Ltd	335.048
4.832	Commonwealth Bank of Australia	319.822
29.615	Transurban Group	273.554
10.968	Woolworths Group Ltd	267.691
1.371	CSL Ltd	264.851
8.015	Wesfarmers Ltd	250.830
9.129	National Australia Bank Ltd	174.706
12.490	Goodman Group (REIT)	152.918
9.972	Westpac Banking Corp	146.925
11.896	Coles Group Ltd	139.585
3.600	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	137.585
10.500	Sun Hung Kai Properties Ltd	136.518
8.288	ANZ Group Holdings Ltd	132.888
12.500	Techtronic Industries Co Ltd	130.462
1.142	Macquarie Group Ltd	129.305
8.091	Newcrest Mining Ltd	128.291
5.200	DBS Group Holdings Ltd	125.548
18.660	Link REIT (Units) (REIT)	117.608
13.222	Brambles Ltd	113.870
28.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	113.337
11.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	99.491
607	Cochlear Ltd	90.820
4.200	United Overseas Bank Ltd	87.386
31.741	Telstra Group Ltd	86.323
10.486	Northern Star Resources Ltd	80.423
82.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	79.060
18.534	Qantas Airways Ltd	78.572
1.556	Mineral Resources Ltd	77.590

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF***Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)**

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
6.365	Wesfarmers Ltd	214.347
17.200	AIA Group Ltd	179.234
2.275	Commonwealth Bank of Australia	154.052
9.643	Goodman Group (REIT)	130.543
637	CSL Ltd	127.988
8.500	Sun Hung Kai Properties Ltd	112.480
10.071	Transurban Group	98.061
14.700	Link REIT (Units) (REIT)	91.853
3.568	Woolworths Group Ltd	89.399
4.037	National Australia Bank Ltd	75.100
1.800	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	73.061
601	Macquarie Group Ltd	71.541
4.347	Westpac Banking Corp	63.134
18.232	Pilbara Minerals Ltd	59.206
6.400	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	59.090
3.649	ANZ Group Holdings Ltd	58.750
21.200	CapitaLand Investment Ltd/Singapore	56.225
17.650	Grab Holdings Ltd	56.193
29.945	Scentre Group (REIT)	55.499
9.000	CK Asset Holdings Ltd	52.615
2.200	DBS Group Holdings Ltd	51.928
2.300	United Overseas Bank Ltd	48.355
9.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	47.660
3.896	Coles Group Ltd	47.052
30.100	CapitaLand Integrated Commercial Trust (Units) (REIT)	45.252
3.275	BlueScope Steel Ltd	45.026
2.516	Newcrest Mining Ltd	44.386
4.184	Allkem Ltd	43.599
4.648	Brambles Ltd	43.028
4.000	Techtronic Industries Co Ltd	41.961
10.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	41.435

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
15.763	Toyota Motor Corp	220.631
2.407	Sony Group Corp	193.965
375	Keyence Corp	152.620
22.783	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	132.626
4.451	Nippon Telegraph & Telephone Corp	126.200
3.577	Daiichi Sankyo Co Ltd	113.937
590	Tokyo Electron Ltd	96.393
2.095	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	93.910
2.209	Nintendo Co Ltd	92.780
3.200	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	92.599
2.936	KDDI Corp	88.747
2.500	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	86.344
2.736	Recruit Holdings Co Ltd	84.328
160	SMC Corp	79.442
1.900	SoftBank Group Corp	76.927
651	Hoya Corp	72.697
3.500	Tokio Marine Holdings Inc	70.837
1.349	Oriental Land Co Ltd/Japan	70.743
209	Fast Retailing Co Ltd	68.699
6.300	SoftBank Corp	65.316
1.200	Murata Manufacturing Co Ltd	64.042
1.200	FANUC Corp	62.929
4.700	Mizuho Financial Group Inc	61.362
1.000	NIDEC CORP	51.734
3.400	Astellas Pharma Inc	49.853
400	Fujitsu Ltd	48.738
2.700	Olympus Corp	47.633

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
2.887	Toyota Motor Corp	43.516
69	SMC Corp	38.921
361	Sony Group Corp	32.117
63	Keyence Corp	29.810
700	Seven & i Holdings Co Ltd	28.940
937	Nippon Telegraph & Telephone Corp	27.678
3.562	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	26.773
711	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	22.669
200	Daito Trust Construction Co Ltd	20.726
1.761	SoftBank Corp	19.612
410	SoftBank Group Corp	19.276
403	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	17.927
171	FANUC Corp	17.445
118	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	17.408
474	Daiichi Sankyo Co Ltd	15.538
43	Tokyo Electron Ltd	15.101
439	Recruit Holdings Co Ltd	14.232
400	TDK Corp	13.791
1.733	Japan Post Holdings Co Ltd	13.677
436	KDDI Corp	13.503
309	Nintendo Co Ltd	13.267
624	Dai-ichi Life Holdings Inc	13.224
237	NIDEC CORP	13.190
73	Shimano Inc	12.602
585	Tokio Marine Holdings Inc	12.323
747	Mizuho Financial Group Inc	11.828
70	Oriental Land Co Ltd/Japan	11.199
622	Olympus Corp	10.792
186	Murata Manufacturing Co Ltd	10.655
273	Kao Corp	10.606
73	Fujitsu Ltd	10.459
17	Fast Retailing Co Ltd	10.265
2.544	Nomura Holdings Inc	10.046

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 8. September 2022 zugelassen. Der Fonds wurde am 20. Oktober 2022 aufgelegt.

L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF*

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios spiegelt die 20 größten Käufe/Verkäufe oder die Gesamtheit der Käufe/Verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe/Verkäufe in dem betreffenden Berichtszeitraum übersteigen. Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 beträgt, werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
505	Microsoft Corp	170.382
599	Meta Platforms Inc - Class A	163.761
874	Apple Inc	160.796
1.326	Exxon Mobil Corp	139.463
780	Chevron Corp	122.549
263	NVIDIA Corp	113.099
107	Broadcom Inc	94.835
734	Alphabet Inc - Class A	90.787
696	Alphabet Inc	86.581
1.461	Samsung Electronics Co Ltd	82.179
844	Alibaba Group Holding Ltd ADR	75.431
2.554	Shell Plc	75.108
1.254	TotalEnergies SE	73.611
231	Accenture Plc - Class A	72.787
561	Amazon.com Inc	70.932
75	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	69.416
2.113	BHP Group Ltd	66.251
143	UnitedHealth Group Inc	65.770
174	Mastercard Inc	65.218
426	JPMorgan Chase & Co	60.284

Es gab im Berichtszeitraum keine Verkäufe.

*Der Fonds wurde durch die Zentralbank am 2. Juni 2023 zugelassen. Der Fonds wurde am 15. Juni 2023 aufgelegt.

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

Die nachstehenden Fonds müssen die Anforderungen von Artikel 8 der SFDR erfüllen und werden als Artikel-8-Fonds gemäß SFDR kategorisiert und bezeichnet:

Fonds

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF
 L&G Cyber Security UCITS ETF
 L&G Battery Value-Chain UCITS ETF
 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF
 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF
 L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF
 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF
 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITSETF
 L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF
 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF
 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF
 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF
 L&G Digital Payments UCITS ETF
 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF
 L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF
 L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF
 L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF
 L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF
 L&G Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF

Die nachstehenden Fonds müssen die Anforderungen von Artikel 9 der SFDR erfüllen und werden als Artikel-8-Fonds gemäß SFDR kategorisiert und bezeichnet:

Fonds

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF
 L&G Clean Water UCITS ETF
 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF
 L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF
 L&G US ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF
 L&G Clean Energy UCITS ETF
 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF
 L&G ESG Green Bond UCITS ETF
 L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF
 L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF

Wertentwicklung im Kalenderjahr (ungeprüft)

Die Performance der Fonds ist auf Kalenderjahrbasis unten abgebildet:

Fonds	Währung	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
		01.01.2017 bis 31.12.2017	01.01.2018 bis 31.12.2018	01.01.2019 bis 31.12.2019	01.01.2020 bis 30.12.2020	01.01.2021 bis 31.12.2021	01.01.2022 bis 30.06.2022	01.01.2023 bis 30.06.2023
L&G Gold Mining UCITS ETF	US\$	13,22 %	-11,29 %	42,58 %	23,19 %	-9,50 %	-15,32 %	6,13 %
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	US\$	3,65 %	-9,68 %	7,99 %	3,11 %	32,68 %	19,11 %	-7,42 %
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	US\$	-8,47 %	-14,79 %	4,57 %	-20,09 %	45,63 %	21,92 %	6,05 %
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	US\$	46,00 %	-20,36 %	29,81 %	44,81 %	15,62 %	-33,49 %	25,71 %
L&G Cyber Security UCITS ETF	US\$	23,40 %	9,12 %	29,96 %	42,01 %	7,28 %	-31,70 %	19,44 %
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	12,67 %	27,09 %	-3,85 %	-7,26 %	-7,44 %
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	31,21 %	42,89 %	18,93 %	-21,82 %	12,64 %
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	17,74 %	79,49 %	15,95 %	-14,01 %	24,10 %
L&G Clean Water UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	19,38 %	26,38 %	-18,34 %	12,19 %
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	67,43 %	9,53 %	-39,38 %	36,25 %
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	65,72 %	0,15 %	-33,34 %	4,18 %
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	GBP	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	1,72 %	-3,02 %	-17,50 %	-1,47 %
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	GBP	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,32 %	-0,82 %	-6,16 %	-0,42 %
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,51 %	-0,30 %	-10,41 %	2,90 %
L&G China CNY Bond UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	1,03 %	7,15 %	-5,88 %	-2,36 %
L&G Clean Energy UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	30,44 %	-6,32 %	-9,40 %	1,12 %
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	-0,20 %	0,00 %	0,00 %
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,24 %	-11,66 %	2,42 %
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	-36,99 %	4,29 %
L&G ESG Green Bond UCITS ETF**	EUR	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	-0,07 %	5,67 %	-2,25 %
L&G Digital Payments UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	-30,38 %	13,03 %
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	1,48 %	-9,00 %	5,13 %
L&G Multi Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	24,34 %	-4,71 %
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF*	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,00 %	13,64 %
L&G Emerging Cyber Security ESG Exclusions UCITS ETF*	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,00 %	29,88 %

Wertentwicklung im Kalenderjahr (ungeprüft) (Fortsetzung)

Fonds	Währung	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
		01.01.2017 bis 31.12.2017	01.01.2018 bis 31.12.2018	01.01.2019 bis 31.12.2019	01.01.2020 bis 30.12.2020	01.01.2021 bis 31.12.2021	01.01.2022 bis 30.06.2022	01.01.2023 bis 30.06.2023
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF*	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,00 %	41,93 %
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF*	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,00 %	12,53 %
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,00 %	0,14 %
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF*	US\$	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	n. zutr.	0,00 %	9,22 %

Nicht zutreffend - noch nicht aufgelegt.

* Im Laufe des Geschäftsjahres aufgelegter Fonds

**geschlossen am 19. Mai 2023

Die frühere Wertentwicklung ist kein Indikator für die derzeitige oder zukünftige Wertentwicklung. Die Angaben zur Wertentwicklung berücksichtigen keine Provisionen und Kosten, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD)
0-5 Year UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800XROKSRGL3IHR64

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja **X** **Nein**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb durch die Anwendung der ESG-Scoring-Methode bei der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie die folgenden ökologischen Merkmale:

- Verringerung der THG-Emissionsintensität.

Nur in Bezug auf quasistaatliche Schuldtitel bewarb der Fonds außerdem die folgenden sonstigen ökologischen und sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe;

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds unterstützte die oben genannten Merkmale, indem er den J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Short-term Custom Maturity Index (der „Index“) verfolgt, der als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale bestimmt ist. Obwohl durch die Anwendung der nachfolgend beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ökologische und soziale Merkmale beworben wurden, ist zu beachten, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Anlageziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Die ESG-Bewertung des Index durch den Indexanbieter im Vergleich zur ESG-Bewertung des entsprechenden *Vergleichsindex;	49,35 % – Indexbewertung 41,43 % – Vergleichswert
2. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde.	14,4 % * Vergleichsindex: J.P. Morgan EMBI Global Diversified 0-5 Year Index

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen über die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds, die nachstehend zusammengefasst und genauer in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds beschrieben wird. Beispielsweise verwendet der Fonds den Indikator „THG-Intensität der Länder, in die investiert wird“, um wichtige nachteilige Auswirkungen in Bezug auf Treibhausgasemissionen zu identifizieren. Danach wählt und ergreift der Fonds Maßnahmen zu den bei der Umsetzung seiner nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 15: THG-Emissionsintensität



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
KUWAIT INTERNATIONAL GO 3.5 20MAR27	Regierung	2,39	Kuwait
CROATIA 6% 26/01/24	Regierung	1,65	Kroatien
KAZAKHSTAN 5.125% 21/07/25	Regierung	1,64	Kasachstan
POLAND 4% 22/01/24	Regierung	1,43	Polen
POLAND REPUBLIC 3.0 17MAR23	Regierung	1,41	Polen
POLAND 3.25% 06/04/26	Regierung	1,35	Polen
QATAR 3.25% 02/06/26	Regierung	1,25	Katar
BRAZIL 4.25% 07/01/25	Regierung	1,24	Brasilien
ABU DHABI GOVERNMENT 3.125 11OCT27	Regierung	1,18	Vereinigte Arabische Emirate
HUNGARY 5.375% 25/03/24	Regierung	1,16	Ungarn
HUNGARY GOVERNMENT IN 6.125 22MAY28	Regierung	1,15	Ungarn
ARGENTINA 0.5% 09/07/30	Regierung	1,13	Argentinien
SOUTH AFRICA 5.875% 16/09/25	Regierung	1,13	Südafrika
JAMAICA 6.75% 28/04/28	Regierung	1,12	Jamaika
REPUBLICA ORIENTAL DE 4.375 27OCT27	Regierung	1,12	Uruguay

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

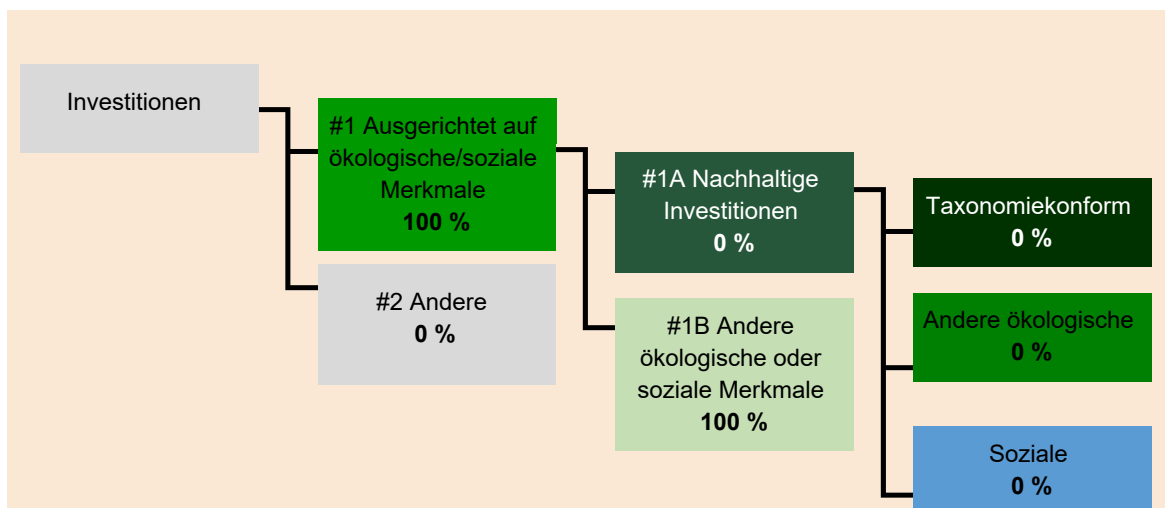
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 100,00 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Keine der Investitionen wurde zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet, dementsprechend fielen die Investitionen unter #2 Andere. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte im Berichtszeitraum keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel und hielt keine nachhaltigen Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurde.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Regierung	Staatsanleihen	88,98
Finanzen	Investmentgesellschaften	2,58
Energie	Öl und Gas	2,32
Finanzen	Banken	1,56
Energie	Pipelines	1,14
Finanzen	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	0,92
Versorgungsunternehmen	Elektro	0,70
Grundstoffe	Bergbau	0,48
Finanzen	Immobilien	0,39
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	0,31
Industriewerte	Spedition und Leasing	0,23
Andere	Andere	0,38

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



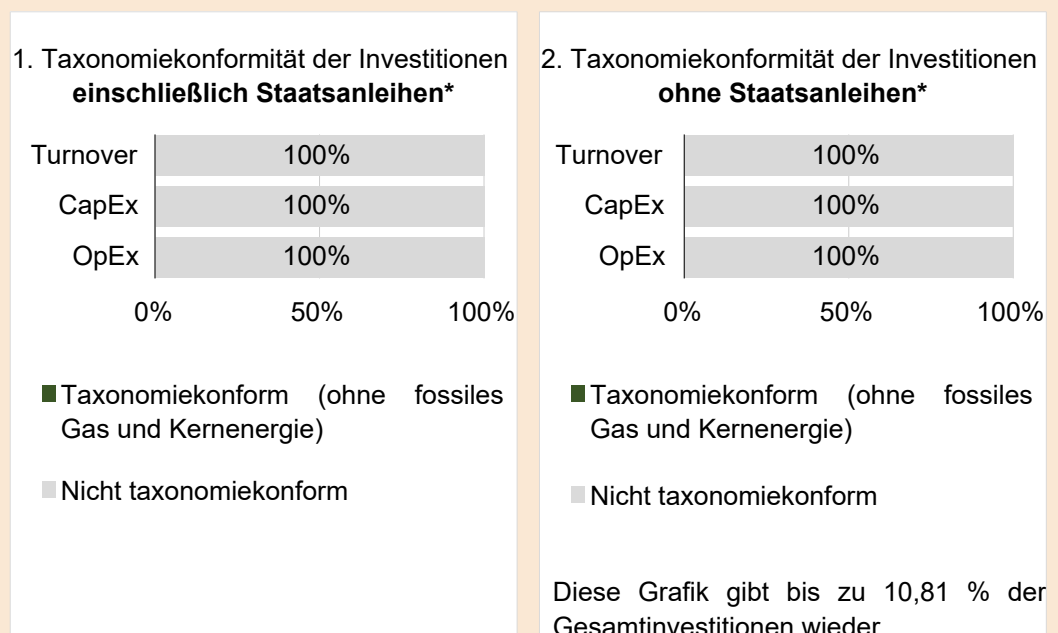
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 0,00 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 0,00 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

K. A.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds verfolgte die unten beschriebene nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete, der:

- (i) quasi-staatliche Emittenten mit einer bestimmten Höhe der Einnahmen aus den Sektoren Thermalkohle, Ölsand, Tabak und Waffen ausschließt,
- (ii) quasi-staatliche Emittenten ausschließt, die gemäß der Methodik des Indexanbieters die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen nicht einhalten; und
- (iii) eine positive Tendenz zu Emittenten, die bei den ESG-Kriterien höher eingestuft sind, und eine Untergewichtung oder einen Ausschluss von Emittenten mit niedrigerem Rang aufweist.

Der Index wendete den ESG-Emittenten-Score des Indexanbieters an, der vom Indexanbieter auf der Grundlage normalisierter ESG-Rohwerte von externen Research-Anbietern berechnet wurde. Die Scores wurden in Bandbreiten eingeteilt, die zur Skalierung des Basisindexmarktwertes jeder Emission verwendet werden.

Darüber hinaus beinhaltete der Index positive Screening-Techniken, bei denen „grüne“ Anleihen (Anleihen, die zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umwelt- und/oder Klimanutzen geschaffen wurden) desselben Emittenten vom Index bevorzugt werden.

Der Index stand im Einklang mit den ökologischen und sozialen Merkmalen des Fonds, indem er ein Engagement in solchen Wertpapieren von Emittenten in Übereinstimmung mit der oben beschriebenen und auf der JP Morgan-Website näher erläuterten Indexmethodik bietet.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 1,00 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,27 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800APRKITDTPSGS59

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 23,41 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb durch die Anwendung der ESG-Scoring-Methode bei der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie die folgenden ökologischen Merkmale:

- Verringerung der Intensität der Treibhausgasemissionen;
- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.
- Unterstützung der biologischen Vielfalt und verantwortungsvolle Landnutzung; und
- Verringerung der Emissionen in das Wasser und Unterstützung der Wasserwirtschaft.

sozialen Merkmale erreicht werden.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Merkmale, indem er den J.P. Morgan Global Credit Index (GCI) ESG Investment Grade GBP Short-term Custom Maturity Index (der „Index“) nachbildete, der als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale dient. Obwohl ökologische und soziale Merkmale durch die Anwendung der unten dargelegten nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie beworben werden, sei der Anleger darauf hingewiesen, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Investitionsziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Die ESG-Bewertung des Index durch den Indexanbieter im Vergleich zur ESG-Bewertung des entsprechenden *Vergleichsindex;	62,62 – Indexbewertung 59,29 – Vergleichswert
2. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindexes, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde.	25,01 % * Vergleichsindex: J.P. Morgan ESG GCI IG DM GBP 0-5 year Unhedged Index

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden („Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen““). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 1: THG-Emissionen
PAI 2: CO-Fußabdruck
PAI 3: THG-Emissionsintensität der Unternehmen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 7: Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
PAI 8: Emissionen in Wasser
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
DNB BANK ASA 2.625 10JUN26 FRN	Finanzen	1,65	Norwegen
NATIONWIDE BUILDI 6.178 07DEC27 FRN	Finanzen	1,64	Vereinigtes Königreich
LVMH MOET HENNESSY LO 1.125 11FEB27	Nichtbasiskonsumgüter	1,53	Frankreich
SCOTTISH WIDOWS LTD 5.5 16JUN23	Finanzen	1,50	Vereinigtes Königreich
DEUTSCHE BANK AG 2.625 16DEC24	Finanzen	1,43	Deutschland
BARCLAYS PLC 2.375 06OCT23 FRN	Finanzen	1,32	Vereinigtes Königreich
BANQUE FEDERATIVE DU CR 1.0 16JUL26	Finanzen	1,31	Frankreich
HEATHROW FUNDING LTD 5.225 15FEB23	Industriewerte	1,27	Jersey
JPMorgan Chase & Co VAR 28/04/26	Finanzen	1,26	USA
BANCO SANTANDER SA 1.375 31JUL24	Finanzen	1,23	Spanien
BARCLAYS PLC 3.25 12FEB27	Finanzen	1,18	Vereinigtes Königreich
UK TSY 0.125% 31/01/28	Regierung	1,17	Vereinigtes Königreich
BARCLAYS PLC 3.125 17JAN24	Finanzen	1,07	Vereinigtes Königreich
GOLDMAN SACHS GROUP IN 4.25 29JAN26	Finanzen	1,04	USA
RAC BOND CO PLC 4.87 06MAY46	Basiskonsumgüter	1,02	Vereinigtes Königreich

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

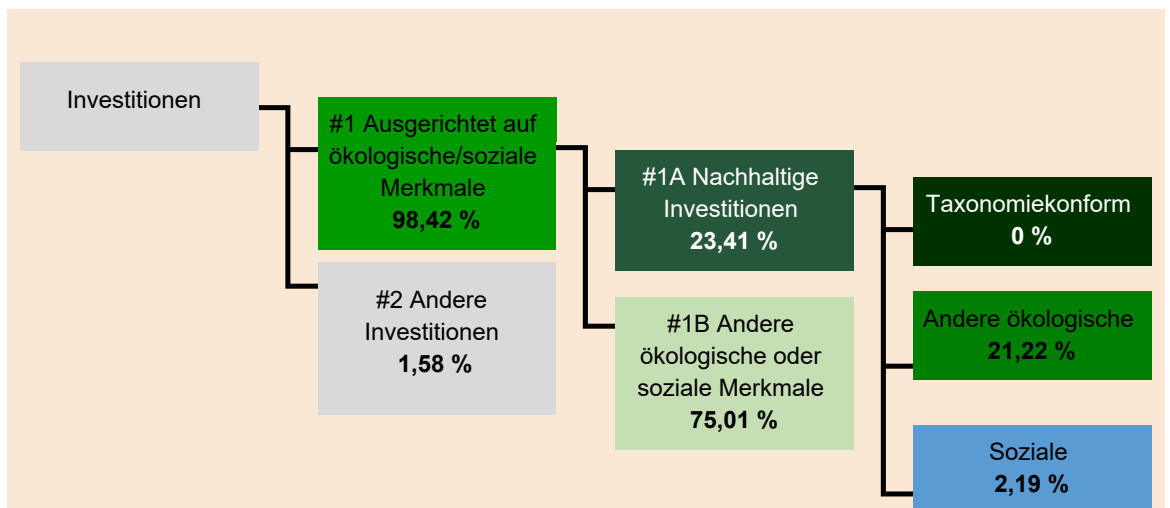
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 98,42 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 23,41 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurde.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilektor	%
Finanzen	Banken	52,60
Finanzen	Versicherung	8,46
Versorgungsunternehmen	Elektro	4,42
Kommunikation	Telekommunikation	4,18
Versorgungsunternehmen	Wasser	3,65
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	3,60
Industriewerte	Bau- und Ingenieurwesen	3,37
Finanzen	Spar- und Darlehensgeschäft	2,59
Finanzen	REITS	2,49
Nichtbasiskonsumgüter	Automobilhersteller	2,18
Basiskonsumgüter	Getränke	1,93
Andere	Andere	10,52

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



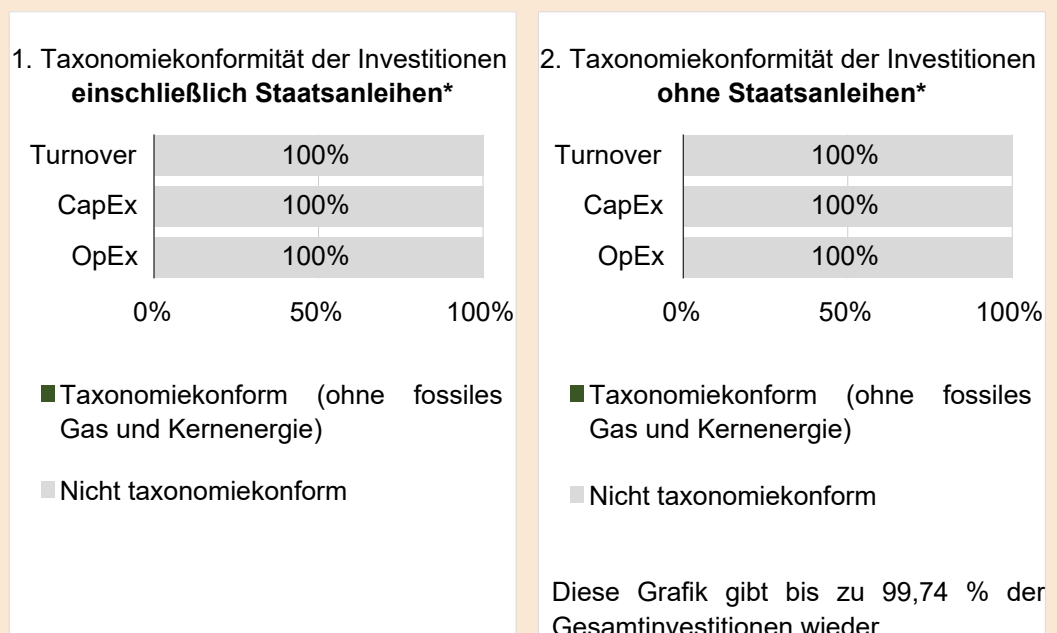
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 21,22 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 2,19 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigt der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds verfolgte die unten beschriebene nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete, der:

- Emittenten ausschloss, die ein bestimmtes Maß an Einnahmen aus den Sektoren Thermalkohle, Ölsand, Tabak und
- Waffen erzielen,
- Emittenten ausschloss, die nicht den Prinzipien des United Nations Global Compact entsprechen, wie
- anhand der Methodik des Indexanbieters bestimmt, und
- eine positive Tendenz zu Emittenten, die bei den ESG-Kriterien höher eingestuft sind, und eine Untergewichtung oder einen Ausschluss von Emittenten mit niedrigerem Rang aufwies.

Der Index wendete einen ESG-Emittenten-Score an, der vom Indexanbieter auf der Grundlage normalisierter ESG-Rohwerte von externen Research-Anbietern berechnet wird. Die Scores wurden in Bandbreiten eingeteilt, die zur Skalierung des Basisindexmarktwertes jeder Emission verwendet wurden.

Darüber hinaus beinhaltete der Index positive Screening-Techniken, bei denen „grüne“ Anleihen (Anleihen, die zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umwelt- und/oder Klimanutzen geschaffen wurden) desselben Emittenten vom Index bevorzugt wurden.

Der Index stand im Einklang mit den ökologischen und sozialen Merkmalen des Fonds, indem er ein Engagement in solchen Wertpapieren von Emittenten in Übereinstimmung mit der oben beschriebenen und auf der JP Morgan-Website näher erläuterten Indexmethodik bot.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 1,00 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,14 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800RYEYWA2DLT6X36

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,17 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb durch die Anwendung der ESG-Scoring-Methode bei der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie die folgenden ökologischen Merkmale:

- Verringerung der Intensität der Treibhausgasemissionen;
- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe;
- Unterstützung von erneuerbaren Energien;
- Unterstützung der biologischen Vielfalt und verantwortungsvolle Landnutzung; und
- Verringerung der Emissionen in das Wasser und Unterstützung der Wasserwirtschaft.

sozialen Merkmale erreicht werden.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Merkmale, indem er den J.P. Morgan Global Credit Index (GCI) ESG Investment Grade GBP Custom Maturity Index (der „Index“) nachbildete, der als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale dient. Obwohl ökologische und soziale Merkmale durch die Anwendung der unten dargelegten nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie beworben werden, sei der Anleger darauf hingewiesen, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Investitionsziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Die ESG-Bewertung des Index durch den Indexanbieter im Vergleich zur ESG-Bewertung des entsprechenden *Vergleichsindex;	63,49 – Indexbewertung 60,10 – Vergleichswert
2. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindexes, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde.	24,78 % * Vergleichsindex: J.P. Morgan ESG GCI IG DM GBP Unhedged Index

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 1: THG-Emissionen
PAI 2: CO-Fußabdruck
PAI 3: THG-Emissionsintensität der Unternehmen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 7: Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
PAI 8: Emissionen in Wasser
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
UNITED KINGDOM GILT 1.0 31JAN32	Regierung	0,82	Vereinigtes Königreich
NATIONAL GRID ELECTRIC 5.75 16APR32	Versorgungsunternehmen	0,72	Vereinigtes Königreich
AT&T Inc 7% 30/04/40	Kommunikation	0,67	USA
UK TSY 0.125% 31/01/24	Regierung	0,59	Vereinigtes Königreich
INVESTEC PLC 1.875 16JUL28 FRN	Finanzen	0,55	Vereinigtes Königreich
CADENT FINANCE PLC 2.125 22SEP28	Versorgungsunternehmen	0,53	Vereinigtes Königreich
KONINKLIJKE KPN NV 5.75 17SEP29	Kommunikation	0,53	Niederlande
ZURICH FINANCE IR 5.125 23NOV52 FRN	Finanzen	0,52	Irland
HEATHROW FUNDING LTD 6.45 10DEC31	Industriewerte	0,50	Jersey
Bank of America Corp 7% 31/07/28	Finanzen	0,49	USA
Centrica PLC 7% 19/09/33	Versorgungsunternehmen	0,49	Vereinigtes Königreich
AT&T Inc 4.875% 01/06/44	Kommunikation	0,47	USA
BARCLAYS PLC 3.75 22NOV30 FRN	Finanzen	0,46	Vereinigtes Königreich
NATIONWIDE BUILDI 6.178 07DEC27 FRN	Finanzen	0,45	Vereinigtes Königreich
BANQUE FEDERATIVE DU C 1.25 05DEC25	Finanzen	0,44	Frankreich

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

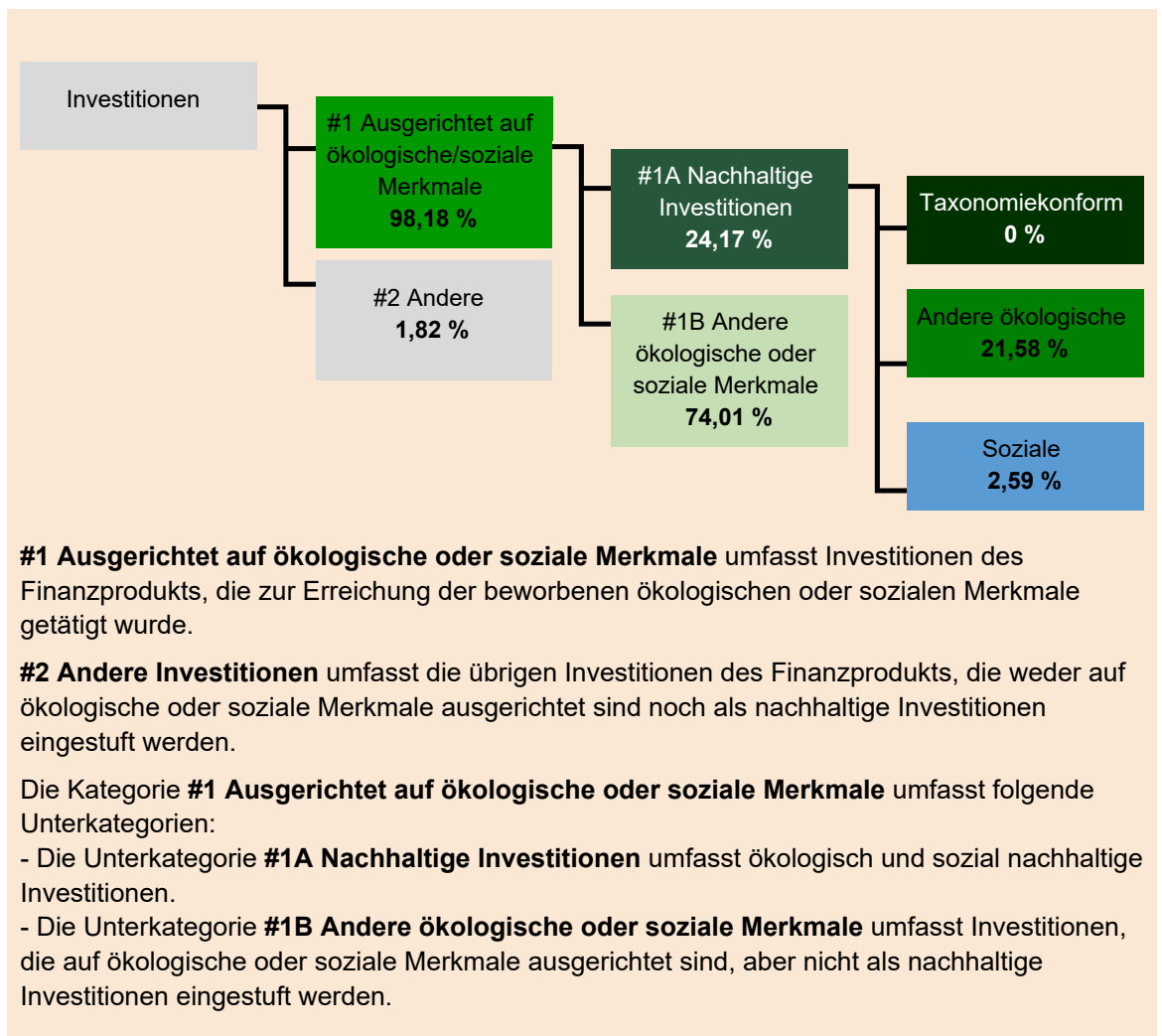
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 98,18 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 24,17 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Finanzen	Banken	36,21
Finanzen	Versicherung	11,31
Kommunikation	Telekommunikation	8,88
Versorgungsunternehmen	Elektro	5,10
Versorgungsunternehmen	Wasser	4,99
Finanzen	Immobilien	4,78
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	4,24
Industriewerte	Bau- und Ingenieurwesen	3,85
Finanzen	REITS	3,44
Versorgungsunternehmen	Erdgas	3,38
Basiskonsumgüter	Getränke	1,74
Andere	Andere	12,09

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



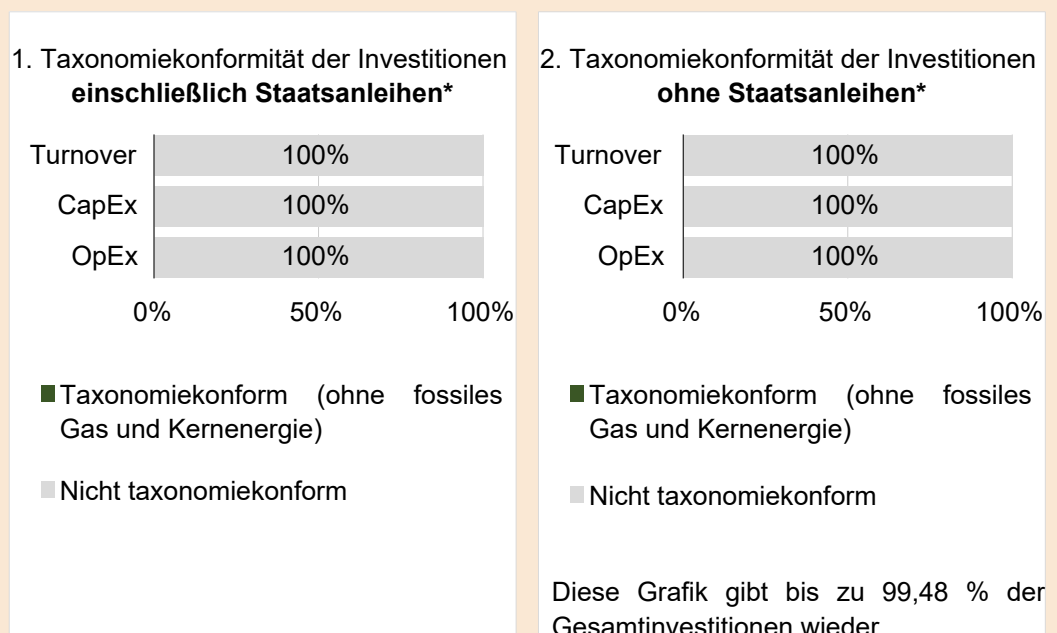
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 21,58 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 2,59 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen werden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds verfolgte die unten beschriebene nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete, der:

- (i) Emittenten ausschloss, die ein bestimmtes Maß an Einnahmen aus den Sektoren Thermalkohle, Ölsand, Tabak und Waffen erzielten,
- (ii) Emittenten ausschloss, die sich nicht an die Global-Compact-Prinzipien der Vereinten Nationen hielten, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt, und
- (iii) eine positive Tendenz zu Emittenten, die bei den ESG-Kriterien höher eingestuft sind, und eine Untergewichtung oder einen Ausschluss von Emittenten mit niedrigerem Rang aufwies.

Der Index wendete einen ESG-Emittenten-Score an, der vom Indexanbieter auf der Grundlage normalisierter ESG-Rohwerte von externen Research-Anbietern berechnet wird. Die Scores wurden in Bandbreiten eingeteilt, die zur Skalierung des Basisindexmarktwertes jeder Emission verwendet werden.

Darüber hinaus beinhaltete der Index positive Screening-Techniken, bei denen „grüne“ Anleihen (Anleihen, die zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umwelt- und/oder Klimanutzen geschaffen wurden) desselben Emittenten vom Index bevorzugt werden.

Der Index steht im Einklang mit den ökologischen und sozialen Merkmalen des Fonds, indem er ein Engagement in solchen Wertpapieren von Emittenten in Übereinstimmung mit der oben beschriebenen und auf der JP Morgan-Website näher erläuterten Indexmethodik bietet.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 1,00 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,20 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800RJN816V7AW9Z31

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,97 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb durch die Anwendung der ESG-Scoring-Methode bei der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie die folgenden Merkmale:

- Verringerung der Intensität der Treibhausgasemissionen;
- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.
- Unterstützung der biologischen Vielfalt und verantwortungsvolle Landnutzung; und
- Verringerung der Emissionen in das Wasser und Unterstützung der Wasserwirtschaft.

sozialen Merkmale erreicht werden.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Merkmale, indem er den J.P. Morgan Global Credit Index (GCI) ESG Investment Grade USD Custom Maturity Index (der „Index“) nachbildete, der als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale dient. Obwohl ökologische und soziale Merkmale durch die Anwendung der unten dargelegten nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie beworben werden, sei der Anleger darauf hingewiesen, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Investitionsziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Die ESG-Bewertung des Index durch den Indexanbieter im Vergleich zur ESG-Bewertung des entsprechenden *Vergleichsindex;	55,00 – Indexbewertung 51,09 – Vergleichswert
2. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	11,51 % * Vergleichsindex: J.P. Morgan GCI IG DM USD Unhedged

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 1: THG-Emissionen
PAI 2: CO-Fußabdruck
PAI 3: THG-Emissionsintensität der Unternehmen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 7: Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
PAI 8: Emissionen in Wasser
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BANK AMER CORP 6.204 10NOV28 FRN	Finanzen	0,68	USA
Centene Corp 2.625% 01/08/31	Basiskonsumgüter	0,48	USA
ING Groep NV VAR 22/03/28	Finanzen	0,46	Niederlande
UBS GROUP AG 3.75 26MAR25	Finanzen	0,40	Schweiz
ABN AMRO Bank NV 4.8% 18/04/26	Finanzen	0,39	Niederlande
BNP Paribas SA 4.4% 14/08/28	Finanzen	0,39	Frankreich
FRESENIUS MED CA 2.375 16FEB31 144A	Basiskonsumgüter	0,39	USA
Credit Suisse Group AG 3.75% 26/03/25	Finanzen	0,36	Schweiz
NATIONWIDE B 4.302 08MAR29 144A FRN	Finanzen	0,35	Vereinigtes Königreich
Scentre Group Trust 1 / Scentre Gr 4.375% 28/05/30	Finanzen	0,35	Australien
HSBC HLDGS PLC 4.583 19JUN29 FRN	Finanzen	0,34	Vereinigtes Königreich
HSBC HLDGS PLC 6.254 09MAR34 FRN	Finanzen	0,34	Vereinigtes Königreich
MOSAIC CO NEW 5.45 15NOV33	Grundstoffe	0,34	USA
Standard Chartered PLC VAR 12/02/30	Finanzen	0,34	Vereinigtes Königreich
AMFAM HLDGS INC 2.805 11MAR31 144A	Finanzen	0,33	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

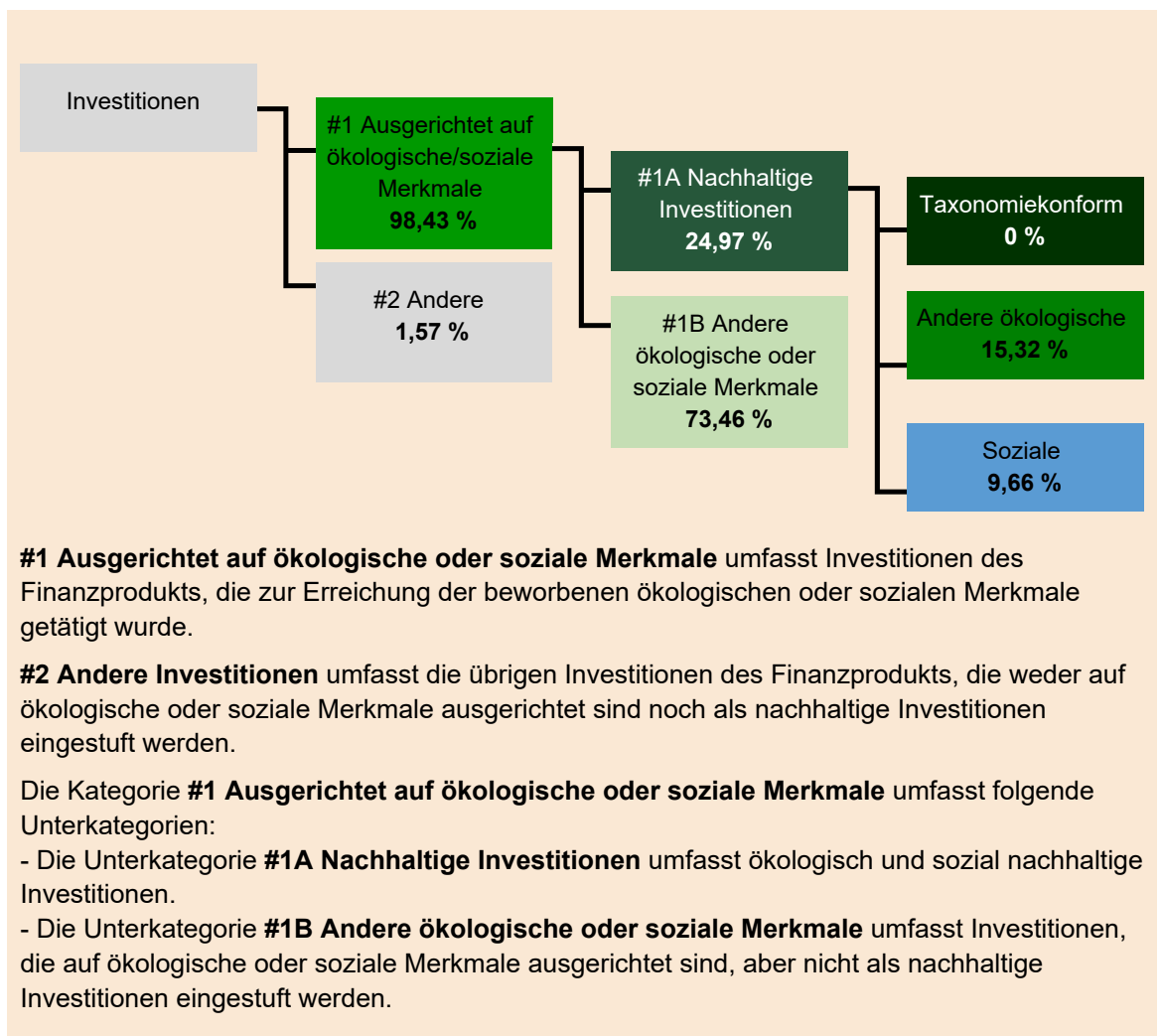
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 98,43 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 24,97 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Finanzen	Banken	30,72
Finanzen	Versicherung	5,62
Kommunikation	Telekommunikation	5,47
Basiskonsumgüter	Pharmazeutische Produkte	4,96
Finanzen	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	4,26
Finanzen	REITS	3,62
Energie	Pipelines	3,49
Basiskonsumgüter	Gesundheitsdienstleistungen	3,32
Technologie	Halbleiter	3,05
Kommunikation	Medien	2,74
Technologie	Software	2,58
Andere	Andere	30,17

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



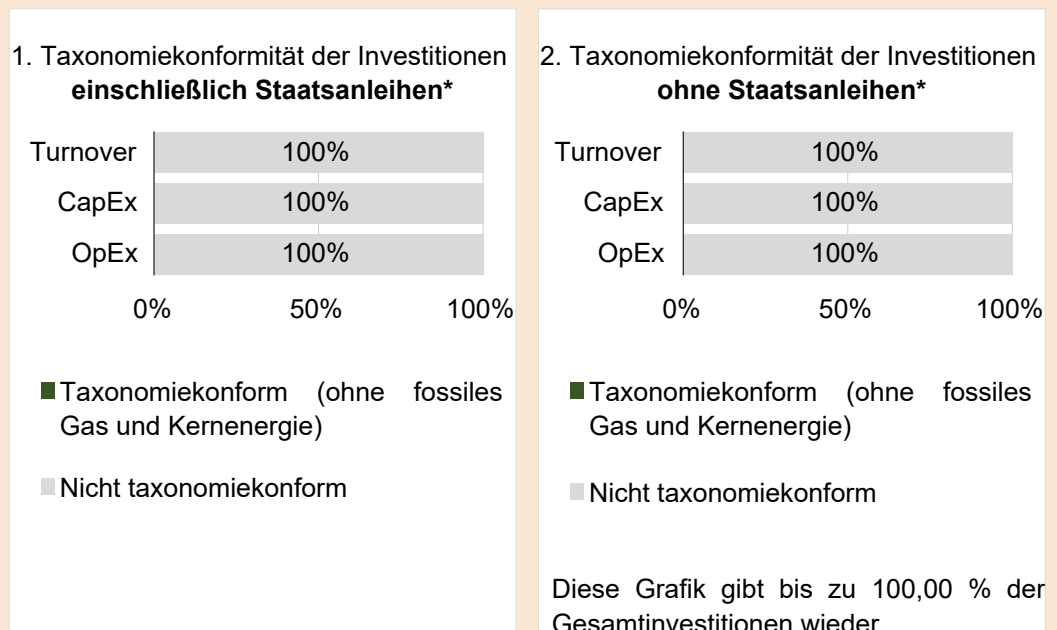
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 15,32 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 9,66 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate können auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wurde.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds verfolgte die unten beschriebene nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete, der:

- (i) Emittenten ausschloss, die ein bestimmtes Maß an Einnahmen aus den Sektoren Thermalkohle, Ölsand, Tabak und Waffen erzielten,
- (ii) Emittenten ausschloss, die sich nicht an die Global-Compact-Prinzipien der Vereinten Nationen hielten, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt, und
- (iii) eine positive Tendenz zu Emittenten, die bei den ESG-Kriterien höher eingestuft sind, und eine Untergewichtung oder einen Ausschluss von Emittenten mit niedrigerem Rang aufwies.

Der Index wendete einen ESG-Emittenten-Score an, der vom Indexanbieter auf der Grundlage normalisierter ESG-Rohwerte von externen Research-Anbietern berechnet wird. Die Scores wurden in Bandbreiten eingeteilt, die zur Skalierung des Basisindexmarktwertes jeder Emission verwendet wurden.

Darüber hinaus beinhaltete der Index positive Screening-Techniken, bei denen „grüne“ Anleihen (Anleihen, die zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umwelt- und/oder Klimanutzen geschaffen wurden) desselben Emittenten vom Index bevorzugt werden.

Der Index stand im Einklang mit den ökologischen und sozialen Merkmalen des Fonds, indem er ein Engagement in solchen Wertpapieren von Emittenten in Übereinstimmung mit der oben beschriebenen und auf der JP Morgan-Website näher erläuterten Indexmethodik bietet.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 1,00 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,19 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800ZBFHCO7362VG69

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 5,76 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb durch die Anwendung der ESG-Scoring-Methode bei der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie die folgenden ökologischen Merkmale:

- Verringerung der Intensität der Treibhausgasemissionen;
- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien;
- Unterstützung der biologischen Vielfalt und verantwortungsvolle Landnutzung; und
- Verringerung der Emissionen in das Wasser und Unterstützung der Wasserwirtschaft.

sozialen Merkmale erreicht werden.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds unterstützte die oben genannten Merkmale, indem er den J.P. Morgan ESG CEMBI Broad Diversified Custom Maturity Index (der „Index“) verfolgt, der als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale bestimmt ist. Obwohl ökologische und soziale Merkmale durch die Anwendung der unten dargelegten nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie beworben wurden, sei der Anleger darauf hingewiesen, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Investitionsziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Die ESG-Bewertung des Index durch den Indexanbieter im Vergleich zur ESG-Bewertung des entsprechenden *Vergleichsindex;	55,76 – Indexbewertung 49,02 – Vergleichswert
2. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	35,10 % * Vergleichsindex: JBCDCOMP Index - J.P. Morgan CEMBI Broad Diversified Index

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 1: THG-Emissionen
PAI 2: CO-Fußabdruck
PAI 3: THG-Emissionsintensität der Unternehmen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 7: Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
PAI 8: Emissionen in Wasser
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
STANDARD CHARTERE 6.301 09JAN29 FRN	Finanzen	0,64	Vereinigtes Königreich
PROSUS N V 3.68 21JAN30 144A	Kommunikation	0,55	Niederlande
GREENSAIF PIPELINES B 6.129 23FEB38	Energie	0,45	Luxemburg
ECOPETROL S A 8.875 13JAN33	Energie	0,44	Kolumbien
PROSUS N V 3.257 19JAN27 144A	Kommunikation	0,44	Niederlande
AMERICA MOVIL SAB DE 6.125 30MAR40	Kommunikation	0,43	Mexiko
STANDARD CHA 2.608 12JAN28 144A FRN	Finanzen	0,43	Vereinigtes Königreich
TEVA PHARMACEUTICAL FI 3.15 01OCT26	Basiskonsumgüter	0,41	Niederlande
ALTICE FINANCING SA 5.75 15AUG29	Kommunikation	0,40	Luxemburg
STANDARD CHA 3.265 18FEB36 144A FRN	Finanzen	0,39	Vereinigtes Königreich
SAUDI ELECTRICITY GLOBA 4.0 08APR24	Versorgungsunternehmen	0,38	Kaimaninseln
STANDARD CHA 2.678 29JUN32 144A FRN	Finanzen	0,38	Vereinigtes Königreich
ECOPETROL S A 6.875 29APR30	Energie	0,36	Kolumbien
STANDARD CHAR 0.00 16NOV28 144A FRN	Finanzen	0,36	Vereinigtes Königreich
STANDARD CHARTERED 6.17 09JAN27 FRN	Finanzen	0,36	Vereinigtes Königreich

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

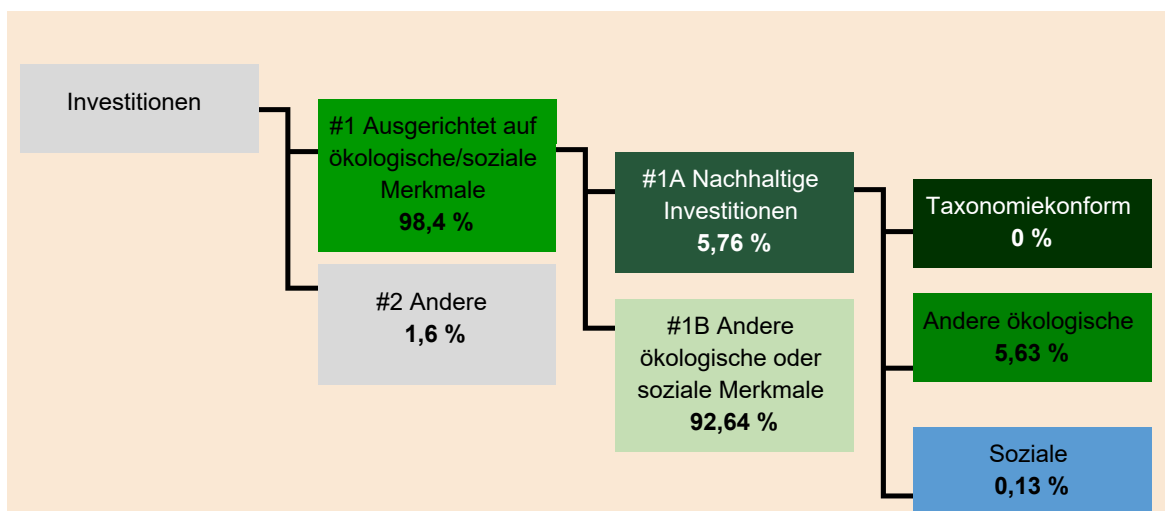
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 98,40 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 5,76 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurde.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Finanzen	Banken	24,90
Energie	Öl und Gas	9,61
Kommunikation	Telekommunikation	5,86
Finanzen	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	4,90
Finanzen	Immobilien	4,88
Versorgungsunternehmen	Elektro	4,65
Grundstoffe	Chemie	4,60
Technologie	Halbleiter	3,83
Nichtbasiskonsumgüter	Hotelgewerbe	3,03
Finanzen	Versicherung	2,83
Energie	Pipelines	2,57
Andere	Andere	28,33

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2- armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



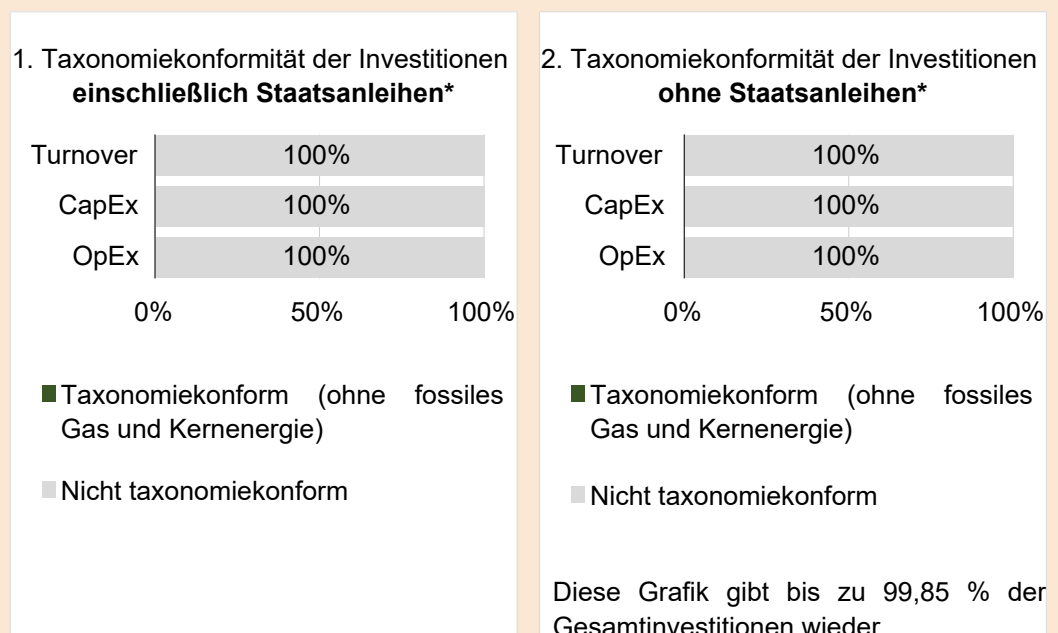
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 5,63 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 0,13 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen können Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate gehören. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds verfolgte die unten beschriebene nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete, der:

- Emittenten ausschloss, die ein bestimmtes Maß an Einnahmen aus den Sektoren Thermalkohle, Ölsand, Tabak und
- Waffen erzielen,
- Emittenten ausschloss, die gegen die Prinzipien des United Nations Global Compact verstießen, wie
- in der Methodik des Indexanbieters festgelegt, und
- eine positive Tendenz zu Emittenten, die bei den ESG-Kriterien höher eingestuft sind, und eine Untergewichtung oder einen Ausschluss von Emittenten mit niedrigerem Rang aufwies.

Der Index wendete einen ESG-Emittenten-Score an, der vom Indexanbieter auf der Grundlage normalisierter ESG-Rohwerte von externen Research-Anbietern berechnet wird. Die Scores wurden in Bandbreiten eingeteilt, die zur Skalierung des Basisindexmarktwertes jeder Emission verwendet wurden.

Darüber hinaus beinhaltete der Index positive Screening-Techniken, bei denen „grüne“ Anleihen (Anleihen, die zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umwelt- und/oder Klimanutzen geschaffen wurden) desselben Emittenten vom Index bevorzugt werden.

Der Index stand im Einklang mit den ökologischen und sozialen Merkmalen des Fonds, indem er ein Engagement in solchen Wertpapieren von Emittenten in Übereinstimmung mit der oben beschriebenen und auf der JP Morgan-Website näher erläuterten Indexmethodik bietet.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 1,00 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,24 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
2138002XWANRF8WHGR26

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja
 Nein

<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: __ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: __ %	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 20,93 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.
---	---



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewirbt die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe, und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Eigenschaften durch die Nachbildung des ROBO Global® Artificial Intelligence Index (der „Index“), der als Referenzbenchmark für die zur Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale festgelegt ist. Obwohl durch die Anwendung der nachfolgend beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ökologische und soziale Merkmale beworben wurden, ist zu beachten, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Anlageziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des Index, der in Unternehmen engagiert ist, die nicht den Ausschlusskriterien entsprechen, die nachstehend dargelegt werden	0 % des Index sind in Unternehmen investiert, die gemäß den Ausschlusskriterien aus dem Index ausgeschlossen sind. Der Anteil der Positionen, die aufgrund der Ausschlusskriterien aus dem Index des Fonds ausgeschlossen werden, beträgt 3,10 %.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ALTERYX INC - CLASS A NPV	Technologie	1,87	USA
ANALOG DEVICES INC USD 0.167	Technologie	1,85	USA
MICROSOFT CORP USD 0.0000125	Technologie	1,85	USA
NVIDIA CORP USD 0.001	Technologie	1,83	USA
SPLUNK INC USD 0.001	Technologie	1,78	USA
ALPHABET INC CLASS A	Kommunikation	1,75	USA
PALO ALTO NETWORKS INC USD 0.0001	Kommunikation	1,74	USA
ARISTA NETWORKS INC USD 0.0001	Kommunikation	1,72	USA
AMAZON COM INC USD 0.01	Kommunikation	1,71	USA
ALIBABA GROUP HLDG USD 0.000025 ADR	Kommunikation	1,68	Kaimaninseln
FAIR ISAAC CORP USD0.01	Technologie	1,68	USA
PURE STORAGE INC - CLASS A USD0.0001	Technologie	1,65	USA
ATLASSIAN CORP LTD USD 0.1	Technologie	1,64	Vereinigtes Königreich
ILLUMINA INC USD 0.01	Basiskonsumgüter	1,64	USA
AMBARELLA INC USD 0.00045	Technologie	1,63	Kaimaninseln

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

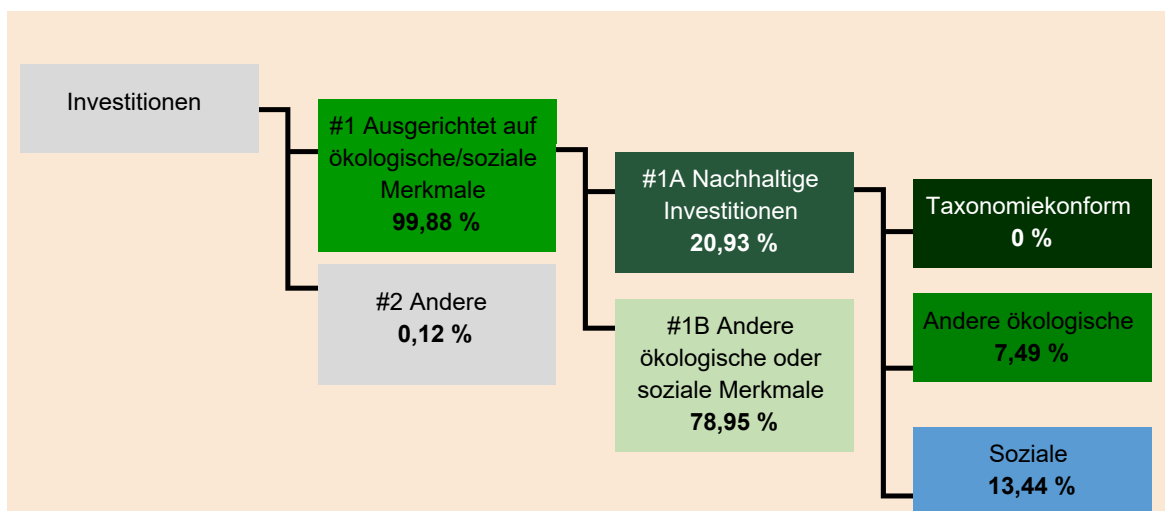
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,88 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 20,93 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurde.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Technologie	Software	38,83
Kommunikation	Internet	19,30
Technologie	Halbleiter	17,72
Technologie	Computer	9,04
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	4,06
Kommunikation	Telekommunikation	2,98
Basiskonsumgüter	Biotechnologie	2,84
Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	1,55
Nichtbasiskonsumgüter	Automobilhersteller	1,44
Finanzen	Versicherung	1,15
Basiskonsumgüter	Gesundheitsprodukte	1,07
Andere	Andere	0,02

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



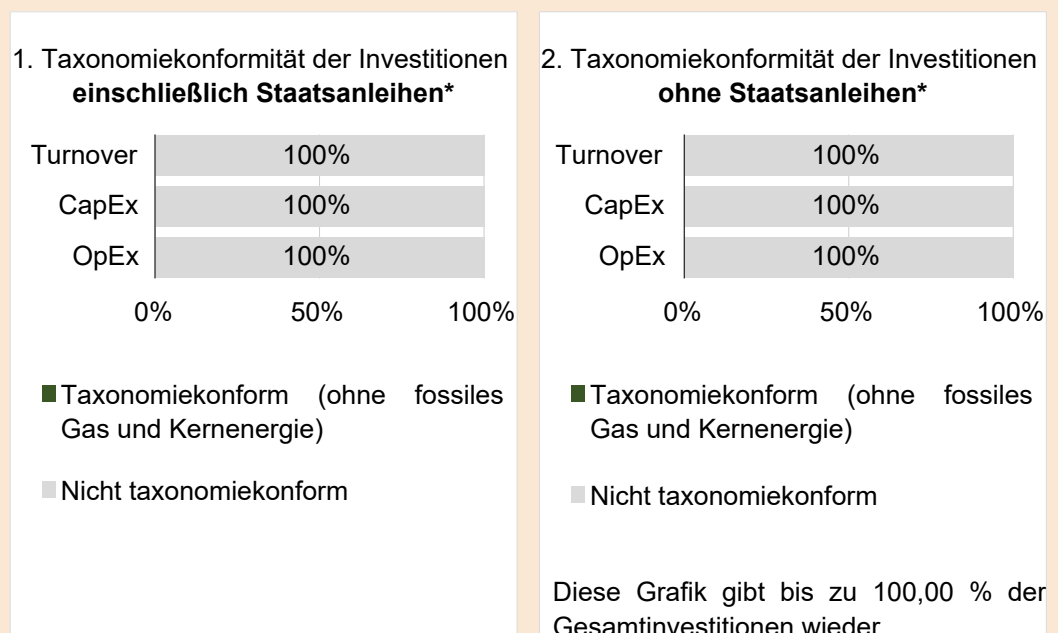
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 7,49 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 13,44 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen werden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht

wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds bildet den anwendbaren Index nach:

ROBO Global ESG Policy: Der Index schloss Investitionen in Unternehmen aus, die sich nicht an die ROBO Global ESG Policy hielten. Der Indexanbieter schloss nach kritischen Beobachtungen Unternehmen aus, die seiner Meinung nach den Zielen in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung maßgeblich schaden. Jeder Emittent innerhalb des Anlageuniversums des Index wurde nach folgenden Kriterien bewertet: i) die ESG-Risiken, denen die Unternehmen ausgesetzt sind, und die Risiken, dass ihre Aktivitäten zu wesentlichen negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen könnten, ii) die Ausrichtung der Unternehmen an internationalen Normen und Standards, einschließlich der Prinzipien des UN Global Compact, iii) die Beteiligung an schädigenden Tätigkeiten wie Waffen und Rüstung, Tabak, Aktivitäten im Zusammenhang mit Kraftwerkskohle, Tätigkeiten im Zusammenhang mit unkonventionellem und konventionellem Öl und Gas, Energieerzeugung und Tierversuchen, und iv) wirtschaftliche Aktivitäten, die zum Thema beitragen.

Der Index-Anbieter bewertete ESG-Faktoren anhand einer Reihe interner Untersuchungen, regelmäßiger Zusammenarbeit mit den im Index vertretenen Unternehmen sowie der Unterstützung seitens führender ESG-Research-Anbieter, um die Einhaltung aller Vorgaben der ROBO Global ESG Policy zu gewährleisten.

Der Fonds ist darauf ausgerichtet, den Index in Übereinstimmung mit seiner Anlagepolitik zu verfolgen. Somit ist die oben dargelegte Anlagestrategie für den Anlageentscheidungsprozess des Fonds verbindlich.

Wie in der oben dargelegten Anlagestrategie und den verbindlichen Anforderungen dargelegt, schließt der Fonds Anlagen in Unternehmen aus; der Fonds strebt jedoch keinen bestimmten Mindestsatz für die Reduzierung seines Anlageuniversums an.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index unterscheidet sich vom relevanten breiten Marktindex durch seinen thematischen Schwerpunkt auf Biotechnologieunternehmen, die sich aktiv mit der Erforschung, Entwicklung und/oder Herstellung von Arzneimitteln zur Behandlung seltener Krankheiten befassen, und stellt daher eine kleinere Untergruppe eines marktbreiten Index dar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,45 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,20 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800WIW0EUI6W4M51

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

X Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

X Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 14,98 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von sauberen Technologien;
- Unterstützung von erneuerbaren Energien; und
- Unterstützung besserer Vorgehensweisen beim Energieverbrauch (oder der Energienutzung)

sozialen Merkmale erreicht werden.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Eigenschaften durch die Nachbildung des Solactive Battery Value-Chain Index Net Total Return (der „Index“), der als Referenzbenchmark für die zur Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale diene.

Obwohl durch die Anwendung der nachfolgend beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ökologische und soziale Merkmale beworben wurden, ist zu beachten, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Anlageziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Engagement für das nachstehend beschriebene Thema;	99,74 %
2. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	Dieser Fonds hat keinen veröffentlichten Hauptindex, sein breit angelegtes Universum besteht jedoch aus einer Reihe von Unternehmen aus thematisch miteinander zusammenhängenden Bereichen, die von Research-Experten für den jeweiligen Bereich ausgewählt werden. Bei diesem von Solactive verwalteten und berechneten Index betrug der Anteil der aufgrund der ESG-Ausschlusskriterien des Index ausgeschlossenen Beteiligungen 12,77 %. Bei Anwendung der geltenden Ausschlüsse auf das gesamte zulässige Anlageuniversum wären vorbehaltlich Liquiditäts- und Handelsbeschränkungen 4,39 % der Positionen ausgeschlossen worden.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
RENAULT SA EUR 3.81	Nichtbasiskonsumgüter	4,60	Frankreich
ENERSYS USD 0.01	Industriewerte	4,43	USA
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES I USD 0.0001	Energie	4,41	USA
DELTA ELECTRONICS INC TWD 10.0	Industriewerte	4,30	Taiwan
BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR 1.0	Nichtbasiskonsumgüter	4,23	Deutschland
MINERAL RESOURCES LTD NPV	Grundstoffe	4,20	Australien
ABB LTD CHF 0.12	Industriewerte	4,15	Schweiz
Mercedes-Benz Group AG EUR NPV	Nichtbasiskonsumgüter	4,14	Deutschland
PILBARA MINERALS LTD NPV	Grundstoffe	4,09	Australien
SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES LT NPV	Nichtbasiskonsumgüter	4,00	Japan
TDK CORP NPV	Industriewerte	3,99	Japan
BYD CO LTD CNY 1.0	Nichtbasiskonsumgüter	3,93	China
PANASONIC CORP NPV	Nichtbasiskonsumgüter	3,88	Japan
NISSAN MOTOR CO LTD NPV	Nichtbasiskonsumgüter	3,85	Japan
TESLA INC USD 0.001	Nichtbasiskonsumgüter	3,84	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

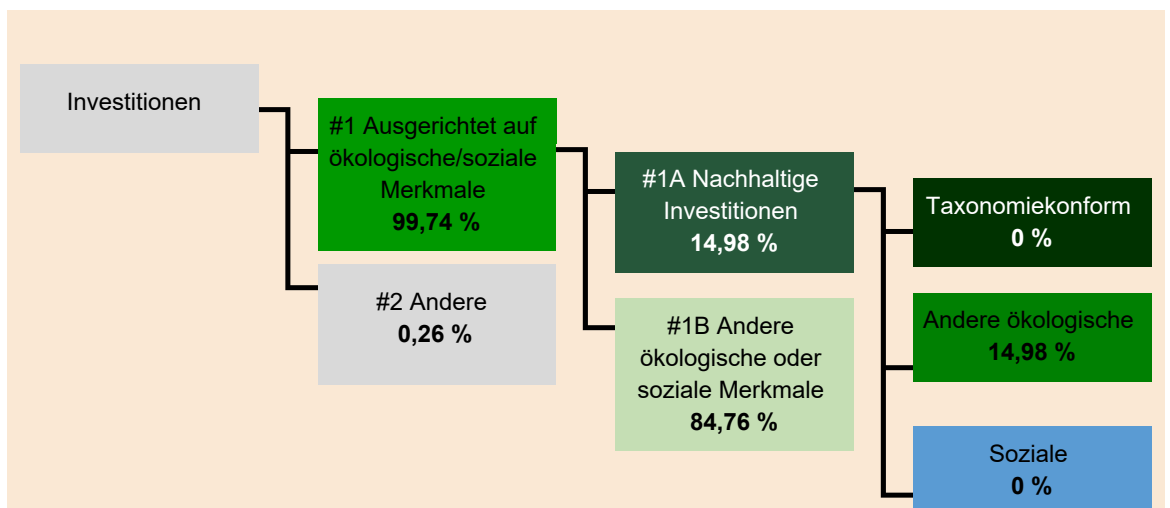
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,74 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 14,98 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurde.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Nichtbasiskonsumgüter	Automobilhersteller	28,24
Nichtbasiskonsumgüter	Autoteile und Autozubehör	11,73
Industriewerte	Elektroteile und -ausrüstung	10,75
Grundstoffe	Bergbau	8,95
Industriewerte	Elektronik	8,10
Industriewerte	Diverse Hersteller	6,09
Energie	Alternative Energiequellen	5,35
Grundstoffe	Eisen/Stahl	4,15
Nichtbasiskonsumgüter	Möbel und Innenausstattung	3,90
Kommunikation	Telekommunikation	3,63
Grundstoffe	Chemie	3,53
Andere	Andere	5,59

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



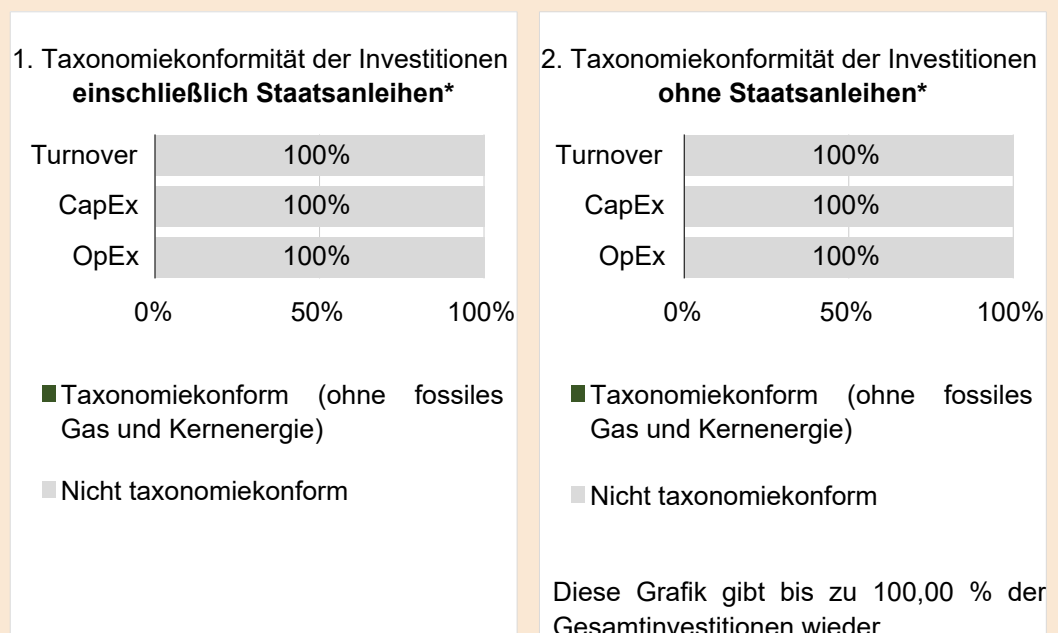
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 14,98 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds ging keine Verpflichtung ein, einen Mindestanteil an sozial nachhaltigen Anlagen zu tätigen.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate können auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wurde.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds bildet den anwendbaren Index nach:

- Unternehmen enthielt, die Metalle produzieren, die hauptsächlich für die Herstellung von Batterien verwendet werden, sowie Unternehmen, die elektrochemische Energiespeichertechnologien (d. h. Batterietechnologien) entwickeln und/oder Batterien produzieren; und
- **ESG-erweiterte Ausschlüsse:** Der Index schloss Unternehmen aus, die (i) den UN Global Compact nicht einhielten, (ii) im Zusammenhang mit einer umstrittenen Angelegenheit standen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt waren, die schwerwiegende Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft hatten und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellten), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit verbundenen Produkt/Dienstleistung, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen, (vi) am Einzelhandel oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nichtangriffswaffen) und an Kunden aus dem militärischen Bereich bzw. der Strafverfolgung sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen, (vii) an der Gewinnung und Verstromung von Kraftwerkskohle oder der Erhöhung der Stromerzeugungskapazität von Kohle, (viii) an der Gewinnung, Produktion oder Kapazitätserhöhung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen, (ix) an der Gewinnung von Ölsand, der Exploration/Extraktion von arktischem Erdöl und Erdgas, der Gewinnung von Schiefergas oder der Kapazitätserhöhung von unkonventionellem Erdöl und Erdgas, (x) an der Produktion, dem Vertrieb, den unterstützenden Produkten oder der Kapazitätserweiterung von Kernenergie, (xi) an der Produktion, dem Einzelhandel oder den damit verbundenen Dienstleistungen/Produkten von Alkohol, (xii) am Betrieb, der Spezialausrüstung oder den unterstützenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen und (xiii) an der Produktion oder dem Vertrieb von Unterhaltung für Erwachsene beteiligt waren.

Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Beteiligung“ wurden vom Indexanbieter festgelegt und auf der Website der Solactive AG näher erläutert.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index unterscheidet sich von einem marktbreiten Index, da er ein thematisches Engagement in Unternehmen bietet, die Metalle produzieren, die in erster Linie für die Herstellung von Batterien gebraucht werden, sowie in Unternehmen, die elektrochemische Energiespeichertechnologien (d. h. Batterietechnologien) entwickeln und/oder Batterien produzieren. Außerdem ist das Anlageuniversum des Index aufgrund der Ausschlüsse kleiner als das eines marktbreiten Index.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,45 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,20 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziele könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die Nachhaltigkeitsziele

Name des Produkts:
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800GUQHPUIT7GGC50

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

X Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 99,71 %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Investitionsziel des Fonds war ein weltweites Engagement in Herstellern von Arzneimitteln zur Behandlung seltener Krankheiten. Der Fonds war bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er die Wertentwicklung des Solactive Pharma Breakthrough Value Index Net Total Return (der „Index“) verfolgte.

Der Index wurde als Referenzwert zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des

dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Fonds festgelegt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des Index, der in Unternehmen engagiert ist, die nicht den Ausschlusskriterien entsprechen, die nachstehend dargelegt werden;	0 % des Index sind in Unternehmen investiert, die gemäß den Ausschlusskriterien aus dem Index ausgeschlossen sind. Dieser Fonds hat keinen veröffentlichten Hauptindex, sein breit angelegtes Universum besteht jedoch aus einer Reihe von Unternehmen aus thematisch miteinander zusammenhängenden Bereichen, die von Research-Experten für den jeweiligen Bereich ausgewählt werden. Bei diesem von Solactive verwalteten und berechneten Index betrug der Anteil der aufgrund der ESG-Ausschlusskriterien des Index ausgeschlossenen Beteiligungen 0,00 %. Bei Anwendung der geltenden Ausschlüsse auf das gesamte zulässige Anlageuniversum wären vorbehaltlich Liquiditäts- und Handelsbeschränkungen 11,91 % der Positionen ausgeschlossen worden.
2. Das Engagement in Unternehmen, die dem unten genannten Nachhaltigkeitskonzept entsprechen.	99,71 %

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?***

Der Anlageverwalter hat eine firmeneigene Methode zur Identifizierung nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BIOGEN INC	Basiskonsumgüter	4,01	USA
HORIZON THERAPEUTICS PLC	Basiskonsumgüter	3,96	Irland
EISAI CO LTD NPV	Basiskonsumgüter	3,76	Japan
ASTRAZENECA PLC NPV ADR	Basiskonsumgüter	3,66	Vereinigtes Königreich
VERTEX PHARMACEUTICALS INC USD 0.01	Basiskonsumgüter	3,62	USA
ABBVIE INC USD 0.01	Basiskonsumgüter	3,51	USA
GENMAB A/S	Basiskonsumgüter	3,48	Dänemark
CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD NPV	Basiskonsumgüter	3,41	Japan
SANOFI	Basiskonsumgüter	3,41	Frankreich
NOVARTIS AG CHF 0.5 ADR	Basiskonsumgüter	3,38	Schweiz
SCICLONE PHARMACEU USD 0.00005 144A	Basiskonsumgüter	3,35	Kaimaninseln
ALNYLAM PHARMACEUTICALS IN USD 0.01	Basiskonsumgüter	3,34	USA
IPSEN EUR1	Basiskonsumgüter	3,33	Frankreich
SINO BIOPHARMACEUTICAL HKD0.025	Basiskonsumgüter	3,32	Hongkong
BRISTOL MYERS SQUIBB CO USD 0.1	Basiskonsumgüter	3,31	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität Die Kriterien für **fossiles Gas** umfassen Emissionsbeschränkungen und einen Wechsel auf vollständig erneuerbare Energie oder kohlenstoffarme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltziele leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Im Folgenden wird angegeben, wie hoch der Anteil der Anlagen des Fonds ist, die im Bezugszeitraum als umweltverträgliche und sozial nachhaltige Investitionen gelten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

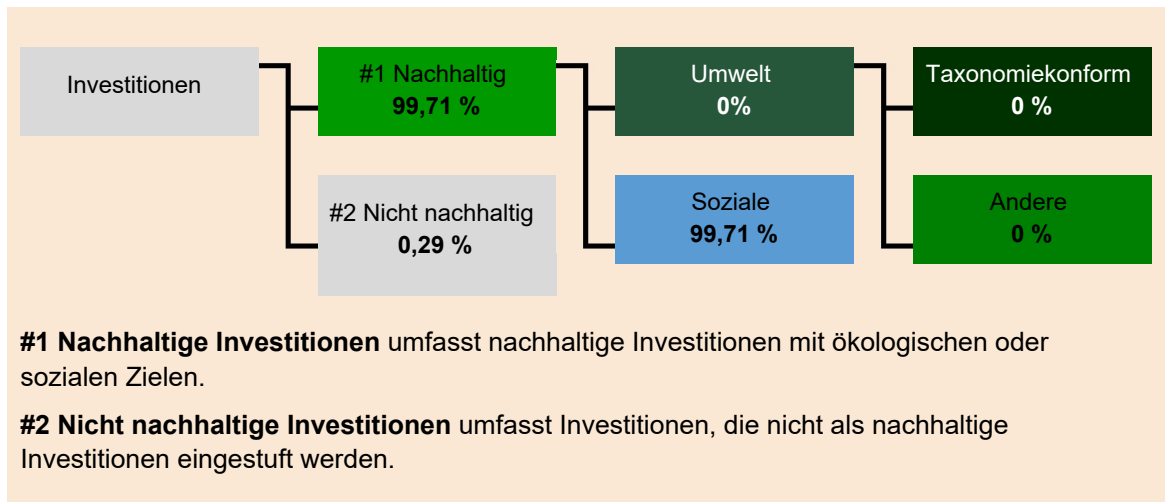
Der Fonds investierte 99,71 % seines Portfolios in Anlagen, die als nachhaltig (#1) eingestuft werden und die alle ein direktes Engagement in den Unternehmen, in die investiert wird, bieten.

Der Fonds investierte 0,00 % seines Portfolios in ökologisch nachhaltige Anlagen und 99,71 % seines Portfolios in sozial nachhaltige Anlagen.

Der verbleibende Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung des nachhaltigen Anlageziels verwendet und fiel unter Nr. 2 Nicht nachhaltig.

Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Basiskonsumgüter	Biotechnologie	61,48
Basiskonsumgüter	Pharmazeutische Produkte	38,52

den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonform Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben**

(CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben**

(OpEx), die die Umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, der Unternehmen, in die investiert wird, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Fonds verpflichtete sich nicht, mehr als 0 % seines Vermögens in mit der EU-Taxonomie konforme Anlagen zu investieren. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

Ja:

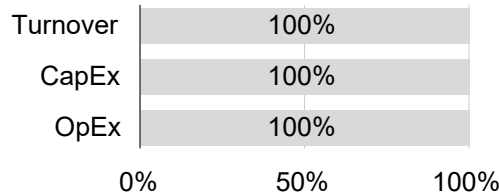
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

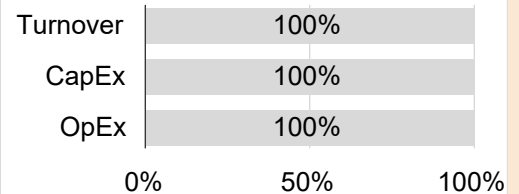
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
■ Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
■ Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt bis zu 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es wird davon ausgegangen, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % beträgt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds hatte kein Engagement in nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel und verpflichtete sich nicht zu einem Mindestanteil solcher Investitionen.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 99,71 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen können Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate gehören. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Fonds verfolgte die folgende nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete:

Nachhaltiges Thema: Der Index setzte sich aus Biotechnologieunternehmen zusammen, die sich aktiv mit der Erforschung, Entwicklung und/oder Herstellung von Arzneimitteln zur Behandlung seltener Krankheiten befassen.

Unternehmen, die für eine Aufnahme in das Indexuniversum in Frage kommen, wurden auf der Grundlage von Branchenklassifizierungsdaten ermittelt, die von einem unabhängigen externen Anbieter von Konsensprognosen führender Branchenanalysten bereitgestellt wurden, sowie anhand einer Analyse der Gesundheitssektoren Pharma und Biotechnologie. Ein Unternehmen, das für die Aufnahme in den Index in Frage kommt, muss über mindestens zwei vermarktete Arzneimittel für seltene Krankheiten verfügen und einen Anteil der Einnahmen aus Arzneimitteln für seltene Krankheiten erzielen, der gemäß den Angaben eines unabhängigen Drittanbieters in den beiden obersten Quartilen der relevanten Unternehmen für Arzneimittel für seltene Krankheiten liegt.

ESG-erweiterte Ausschlüsse: Der Index schloss Unternehmen aus, die (i) den UN Global Compact nicht einhielten, (ii) im Zusammenhang mit einer umstrittenen Angelegenheit standen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt waren, die schwerwiegende Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft hatten und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellten), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit verbundenen Produkt/Dienstleistung, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen, (vi) am Einzelhandel oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nichtangriffswaffen) und an Kunden aus dem militärischen Bereich bzw. der Strafverfolgung sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen, (vii) an der Gewinnung und Verstromung von Kraftwerkskohle oder der Erhöhung der Stromerzeugungskapazität von Kohle, (viii) an der Gewinnung, Produktion oder Kapazitätserhöhung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen, (ix) an der Gewinnung von Ölsand, der Exploration/Extraktion von arktischem Erdöl und Erdgas, der Gewinnung von Schiefergas oder der Kapazitätserhöhung von unkonventionellem Erdöl und Erdgas, (x) an der Produktion, dem Vertrieb, den unterstützenden Produkten oder der Kapazitätserweiterung von Kernenergie, (xi) an der Produktion, dem Einzelhandel oder den damit verbundenen Dienstleistungen/Produkten von Alkohol, (xii) am Betrieb, der Spezialausrüstung oder den unterstützenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen und (xiii) an der Produktion oder dem Vertrieb von Unterhaltung für Erwachsene beteiligt waren. Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Beteiligung“ werden vom Indexanbieter festgelegt und auf der Website der Solactive AG näher erläutert.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckte verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wurde zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, war aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den

vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index unterscheidet sich vom relevanten breiten Marktindex durch seinen thematischen Schwerpunkt auf Biotechnologieunternehmen, die sich aktiv mit der Erforschung, Entwicklung und/oder Herstellung von Arzneimitteln zur Behandlung seltener Krankheiten befassen, und stellt daher eine kleinere Untergruppe eines marktbreiten Index dar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Bestandteilen, die in Einklang mit der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie standen. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,35 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,14 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-Ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziele könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die Nachhaltigkeitsziele

Name des Produkts:
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800J61B1UV4KX2A50

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

X Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 100 %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Investitionsziel des Fonds war ein Engagement in der globalen Gesundheitstechnologiebranche. Der Fonds versuchte, sein Investitionsziel durch Nachbildung der Wertentwicklung des ROBO Global® Healthcare Technology and Innovation Index TR („Index“) zu erreichen.

Der Index ist ein Referenzwert, der zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des

dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Fonds festgelegt wurde.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des Index, der in Unternehmen engagiert ist, die nicht den Ausschlusskriterien entsprechen, die nachstehend dargelegt werden;	0 % des Index sind in Unternehmen investiert, die gemäß den Ausschlusskriterien aus dem Index ausgeschlossen sind. Der Anteil der Positionen, die aufgrund der Ausschlusskriterien aus dem Index des Fonds ausgeschlossen werden, beträgt 0 %. Der Index wendete verschiedene Ausschlusskriterien auf Unternehmen an, die während des Berichtszeitraums bestimmte Mindestanforderungen an weltweit akzeptierte Geschäftspraktiken nicht erfüllten. Aufgrund des eingeschränkten Anlageuniversums des Fonds hatten diese Ausschlüsse in diesem Berichtszeitraum keine Auswirkungen auf das Portfolio, da alle vom Fonds gehaltenen Anlagen die Mindeststandards erfüllten.
2. Das Engagement in Unternehmen, die dem unten genannten Nachhaltigkeitskonzept entsprechen.	100 %

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?***

Der Anlageverwalter hat eine firmeneigene Methode zur Identifizierung nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden („Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen““). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
PENUMBRA INC USD 0.001	Basiskonsumgüter	1,75	USA
STRYKER CORP USD 0.1	Basiskonsumgüter	1,74	USA
INTUITIVE SURGICAL INC USD 0.001	Basiskonsumgüter	1,71	USA
BOSTON SCIENTIFIC CORP USD 0.01	Basiskonsumgüter	1,68	USA
INSULET CORP USD 0.001	Basiskonsumgüter	1,68	USA
ALNYLAM PHARMACEUTICALS IN USD 0.01	Basiskonsumgüter	1,66	USA
DEXCOM INC USD 0.001	Basiskonsumgüter	1,66	USA
THERMO FISHER SCIENTIFIC IN USD 1.0	Basiskonsumgüter	1,66	USA
QIAGEN N.V. EUR0.01	Basiskonsumgüter	1,65	USA
CHARLES RIV LABORATORIES I USD 0.01	Basiskonsumgüter	1,63	USA
DANAHER CORP USD 0.01	Basiskonsumgüter	1,62	USA
INTEGRA LIFESCIENCES HLDGS USD 0.01	Basiskonsumgüter	1,62	USA
AZENTA INC USD0.01	Basiskonsumgüter	1,61	USA
NATERA INC USD 0.0001	Basiskonsumgüter	1,61	USA
REGENERON PHARMACEUTICALS USD 0.001	Basiskonsumgüter	1,61	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität Die Kriterien für **fossiles Gas** umfassen Emissionsbeschränkungen und einen Wechsel auf vollständig erneuerbare Energie oder kohlenstoffarme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Im Folgenden wird angegeben, wie hoch der Anteil der Anlagen des Fonds ist, die im Bezugszeitraum als umweltverträgliche und sozial nachhaltige Investitionen gelten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

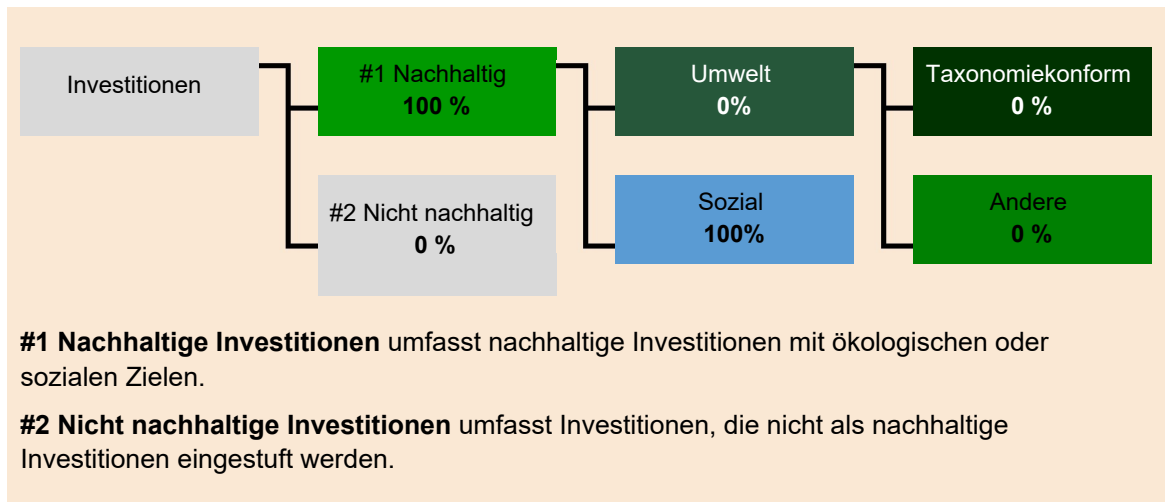
Der Fonds investierte 100,00 % seines Portfolios in Anlagen, die als nachhaltig (#1) eingestuft werden und die alle ein direktes Engagement in den Unternehmen, in die investiert wird, bieten.

Der Fonds investierte 0,00 % seines Portfolios in ökologisch nachhaltige Anlagen und 100,00 % seines Portfolios in sozial nachhaltige Anlagen.

Alle Investitionen wurden zur Erreichung des nachhaltigen Anlageziels verwendet, dementsprechend fielen keine Investitionen unter #2 Nicht nachhaltig.

Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

den besten Leistungen entsprechen.

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Basiskonsumgüter	Gesundheitsprodukte	55,95
Basiskonsumgüter	Biotechnologie	17,92
Basiskonsumgüter	Gesundheitsdienstleistungen	10,38
Basiskonsumgüter	Pharmazeutische Produkte	5,28
Technologie	Software	4,35
Industriewerte	Elektronik	1,37
Nichtbasiskonsumgüter	Retail	1,20
Grundstoffe	Chemie	1,12
Industriewerte	Elektroteile und -ausrüstung	1,11
Technologie	Computer	0,95
Kommunikation	Telekommunikation	0,36

Taxonomiekonform Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die Umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Fonds verpflichtete sich nicht, mehr als 0 % seines Vermögens in mit der EU-Taxonomie konforme Anlagen zu investieren. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

Ja:

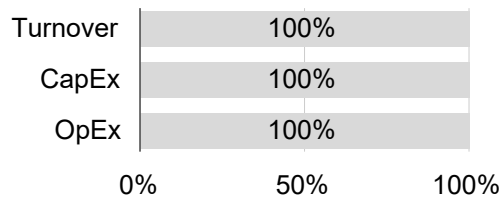
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

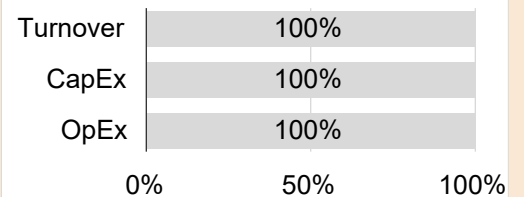
1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt bis zu 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es wird davon ausgegangen, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % beträgt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds hatte kein Engagement in nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel und verpflichtete sich nicht zu einem Mindestanteil solcher Investitionen.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 100,00 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

K. A.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Fonds verfolgte die folgende nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete:

Nachhaltiges Thema: Der Index bestand aus Unternehmen, die sich aktiv in der Wertschöpfungskette der Gesundheitstechnologie betätigten und versuchten, einen Beitrag zu mehr Effizienz und Effektivität im Gesundheitswesen zu leisten sowie Fortschritte und Innovationen in der Gesundheitsbranche zu fördern.

ROBO Global ESG Policy: Der Index schloss Investitionen in Unternehmen aus, die sich nicht an die ROBO Global ESG Policy hielten. Der Indexanbieter schloss nach kritischen Beobachtungen Unternehmen aus, die seiner Meinung nach in signifikanter Weise gegen den Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ (DNSH) verstießen. Jeder Emittent innerhalb des Anlageuniversums des Index wird nach folgenden Kriterien bewertet: i) die ESG-Risiken, denen die Unternehmen ausgesetzt sind, und die Risiken, dass ihre Aktivitäten zu wesentlichen negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen könnten, ii) die Ausrichtung der Unternehmen an internationalen Normen und Standards, einschließlich der Prinzipien des UN Global Compact, iii) die Beteiligung an schädigenden Tätigkeiten wie Waffen und Rüstung, Tabak, Aktivitäten im Zusammenhang mit Kraftwerkskohle, Tätigkeiten im Zusammenhang mit unkonventionellem und konventionellem Öl und Gas, Energieerzeugung und Tierversuchen, und iv) wirtschaftliche Aktivitäten, die zum Thema beitragen.

Der Index-Anbieter bewertete ESG-Faktoren anhand einer Reihe interner Untersuchungen, regelmäßiger Zusammenarbeit mit den im Index vertretenen Unternehmen sowie der Unterstützung seitens führender ESG-Research-Anbieter, um die Einhaltung aller Vorgaben der ROBO Global ESG Policy zu gewährleisten.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index unterscheidet sich von dem entsprechenden breiten Marktindex durch sein thematisches Engagement in Unternehmen, die sich aktiv in der Wertschöpfungskette der Gesundheitstechnologie betätigen und versuchen, einen Beitrag zu mehr Effizienz und Effektivität im Gesundheitswesen zu leisten sowie Fortschritte und Innovationen in der Gesundheitsbranche zu fördern. Der Index stellt daher eine kleinere Teilmenge eines breiten Marktindex dar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Bestandteilen, die in Einklang mit der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie standen. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,45 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,11 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-Ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G Digital Payments UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800AGBRXNUNMQAL33

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

X Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

X Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 10,68 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Belange, indem er den Solactive Digital Payments Index NTR (der „Index“) nachbildet, der als Referenz-Index für die Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Belange bestimmt ist. Obwohl ökologische und soziale Merkmale durch die Anwendung der unten dargelegten nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie beworben werden, sei der Anleger darauf hingewiesen, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Investitionsziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	Dieser Fonds hat keinen veröffentlichten Hauptindex, sein breit angelegtes Universum besteht jedoch aus einer Reihe von Unternehmen aus thematisch miteinander zusammenhängenden Bereichen, die von Research-Experten für den jeweiligen Bereich ausgewählt werden. Bei diesem von Solactive verwalteten und berechneten Index betrug der Anteil der aufgrund der ESG-Ausschlusskriterien des Index ausgeschlossenen Beteiligungen 0,00 %. Bei Anwendung der geltenden Ausschlüsse auf das gesamte zulässige Anlageuniversum wären vorbehaltlich Liquiditäts- und Handelsbeschränkungen 11,91 % der Positionen ausgeschlossen worden.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden die in Tabelle 1 von Anhang I der SFDR aufgeführten Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen in die Methodik für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BTRS HLDGS INC USD 0.0001	Technologie	4,92	USA
EVO PMTS INC USD 0.0001	Basiskonsumgüter	3,56	USA
FLYWIRE CORP USD 0.0001	Basiskonsumgüter	2,96	USA
REMITLY GLOBAL INC USD 0.0001	Basiskonsumgüter	2,95	USA
INTERNATIONAL MONEY EXPR USD 0.0001	Finanzen	2,85	USA
WISE PLC - A GBP 1.0000	Basiskonsumgüter	2,82	Vereinigtes Königreich
COUPA SOFTWARE INC USD 0.0001	Technologie	2,63	USA
PAYONEER GLOBAL INC USD 0.01	Basiskonsumgüter	2,61	USA
FAIR ISAAC CORP USD0.01	Technologie	2,59	USA
SHIFT4 PMTS INC USD 0.0001	Basiskonsumgüter	2,59	USA
ACI WORLDWIDE INC USD 0.005	Technologie	2,53	USA
YEAHKA LTD HKD 0.0000	Basiskonsumgüter	2,53	Hongkong
SHOPIFY INC - CLASS A NPV	Kommunikation	2,52	USA
PAYA HLDGS INC USD 0.0001	Basiskonsumgüter	2,47	USA
CREDIT SAISON CO LTD NPV	Finanzen	2,46	Japan

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

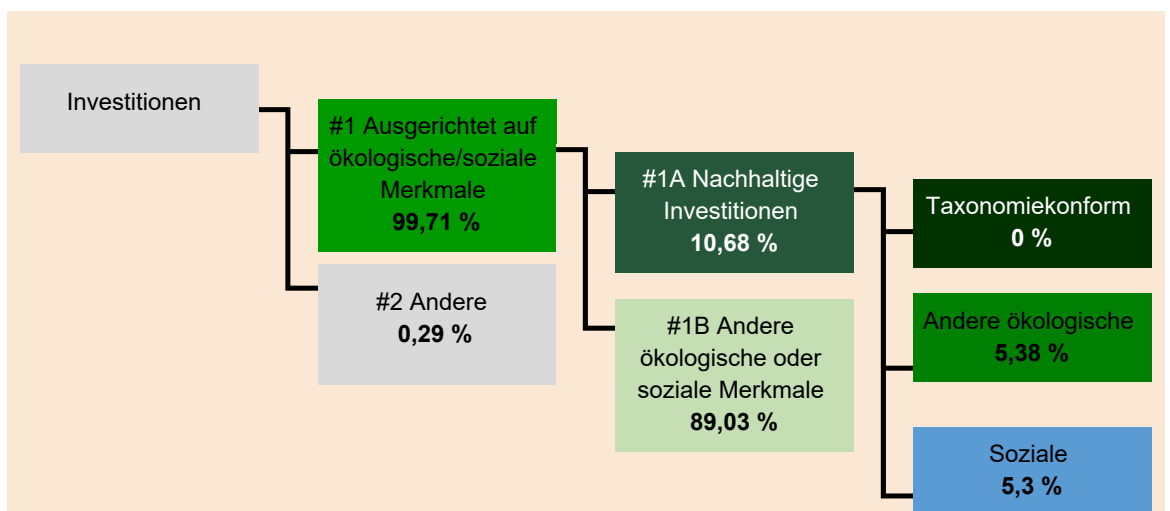
Im Folgenden ist angegeben, welcher Anteil des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewarb und welcher Anteil auf nachhaltige Investitionen entfiel.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,71 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 10,68 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurde.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	58,14
Technologie	Software	17,97
Finanzen	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	16,22
Kommunikation	Internet	5,25
Technologie	Computer	2,42

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



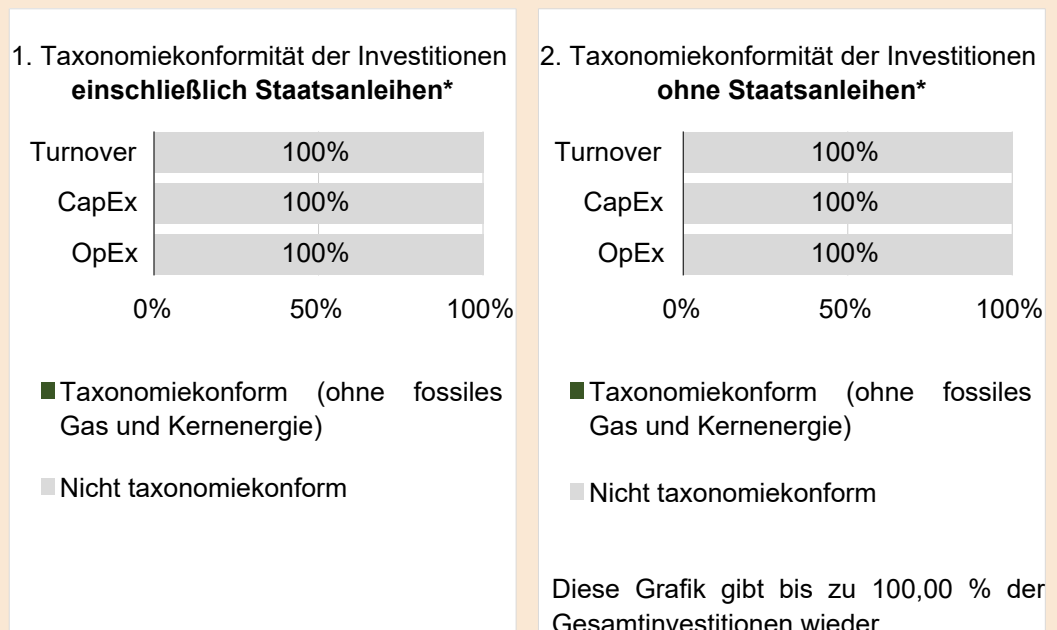
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 5,38 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 5,30 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate können auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wurde.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds bildete den anwendbaren Index nach:

ESG-erweiterte Ausschlüsse: Der Index schloss Unternehmen aus, die (i) den UN Global Compact nicht einhielten, (ii) im Zusammenhang mit einer umstrittenen Angelegenheit standen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt waren, die schwerwiegende Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft hatten und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellten), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit verbundenen Produkt/Dienstleistung, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen, (vi) am Einzelhandel oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nichtangriffswaffen) und an Kunden aus dem militärischen Bereich bzw. der Strafverfolgung sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen, (vii) an der Gewinnung und Verstromung von Kraftwerkskohle oder der Erhöhung der Stromerzeugungskapazität von Kohle, (viii) an der Gewinnung, Produktion oder Kapazitätserhöhung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen, (ix) an der Gewinnung von Ölsand, der Exploration/Extraktion von arktischem Erdöl und Erdgas, der Gewinnung von Schiefergas oder der Kapazitätserhöhung von unkonventionellem Erdöl und Erdgas, (x) an der Produktion, dem Vertrieb, den unterstützenden Produkten oder der Kapazitätserweiterung von Kernenergie, (xi) an der Produktion, dem Einzelhandel oder den damit verbundenen Dienstleistungen/Produkten von Alkohol, (xii) am Betrieb, der Spezialausrüstung oder den unterstützenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen und (xiii) an der Produktion oder dem Vertrieb von Unterhaltung für Erwachsene beteiligt waren.

Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Beteiligung“ wurden vom Indexanbieter festgelegt und auf der Website der Solactive AG näher erläutert.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,35 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,44 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-Ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
2138006NLZDIH3Z7DI42

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

X Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

X Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 3,49 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Eigenschaften durch die Nachbildung des Solactive eCommerce Logistics Index Net Total Return (der „Index“), der als Referenzbenchmark für die zur Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale diente. Obwohl durch die Anwendung der nachfolgend beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ökologische und soziale Merkmale beworben wurden, ist zu beachten, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Anlageziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
<p>1. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde</p>	<p>Dieser Fonds hat keinen veröffentlichten Hauptindex, sein breit angelegtes Universum besteht jedoch aus einer Reihe von Unternehmen aus thematisch miteinander zusammenhängenden Bereichen, die von Research-Experten für den jeweiligen Bereich ausgewählt werden. Bei diesem von Solactive verwalteten und berechneten Index betrug der Anteil der aufgrund der ESG-Ausschlusskriterien des Index ausgeschlossenen Beteiligungen 5,95 %.</p> <p>Bei Anwendung der geltenden Ausschlüsse auf das gesamte zulässige Anlageuniversum wären vorbehaltlich Liquiditäts- und Handelsbeschränkungen 11,91 % der Positionen ausgeschlossen worden.</p>

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen einging, wandte der Anlageverwalter eine proprietäre Methode zur Identifizierung nachhaltiger Investitionen geringen Umfangs an, um zu gewährleisten, dass diese nachhaltigen Investitionen keine erheblichen negativen Auswirkungen auf ökologische oder soziale Ziele hatten („DNSH-Bewertung“). Diese Methode prüfte potenzielle nachhaltige Investitionen auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, auf Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und auf bestimmte Bewertungen bezüglich Kontroversen. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 von Anhang I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission genannten Indikatoren herangezogen („SFDR-Maßnahmen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung für nachhaltige Investitionen aus, die im Hinblick auf die oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden die in Tabelle 1 von Anhang I der SFDR aufgeführten Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen in die Methodik für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NIPPON YUSEN KABUSHIKI KAISHA	Industriewerte	7,38	Japan
LOGISTEED LTD NPV	Industriewerte	3,56	Japan
VIPSHOP HLDGS LTD USD 0.0001 ADR	Kommunikation	3,55	Kaimaninseln
CIA DE DISTRIBUCION INTEGRA EUR 0.2	Industriewerte	3,26	Spanien
ORACLE CORP USD 0.01	Technologie	3,14	USA
SHOPIFY INC - CLASS A NPV	Kommunikation	3,14	Kanada
ZALANDO SE EUR 1.0 144A	Nichtbasiskonsumgüter	3,13	Deutschland
DSV A/S	Industriewerte	3,12	Dänemark
GXO LOGISTICS INC USD 0.01	Basiskonsumgüter	3,04	USA
SPS COMM INC USD 0.001	Technologie	2,99	USA
EXPEDITORS INTL WASH INC USD 0.01	Industriewerte	2,98	USA
SAP SE NPV	Technologie	2,98	Deutschland
DEUTSCHE POST AG-REG NPV	Industriewerte	2,97	Deutschland
MANHATTAN ASSOCIATES INC USD0.01	Technologie	2,91	USA
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONA CHF 1.0	Industriewerte	2,90	Schweiz

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

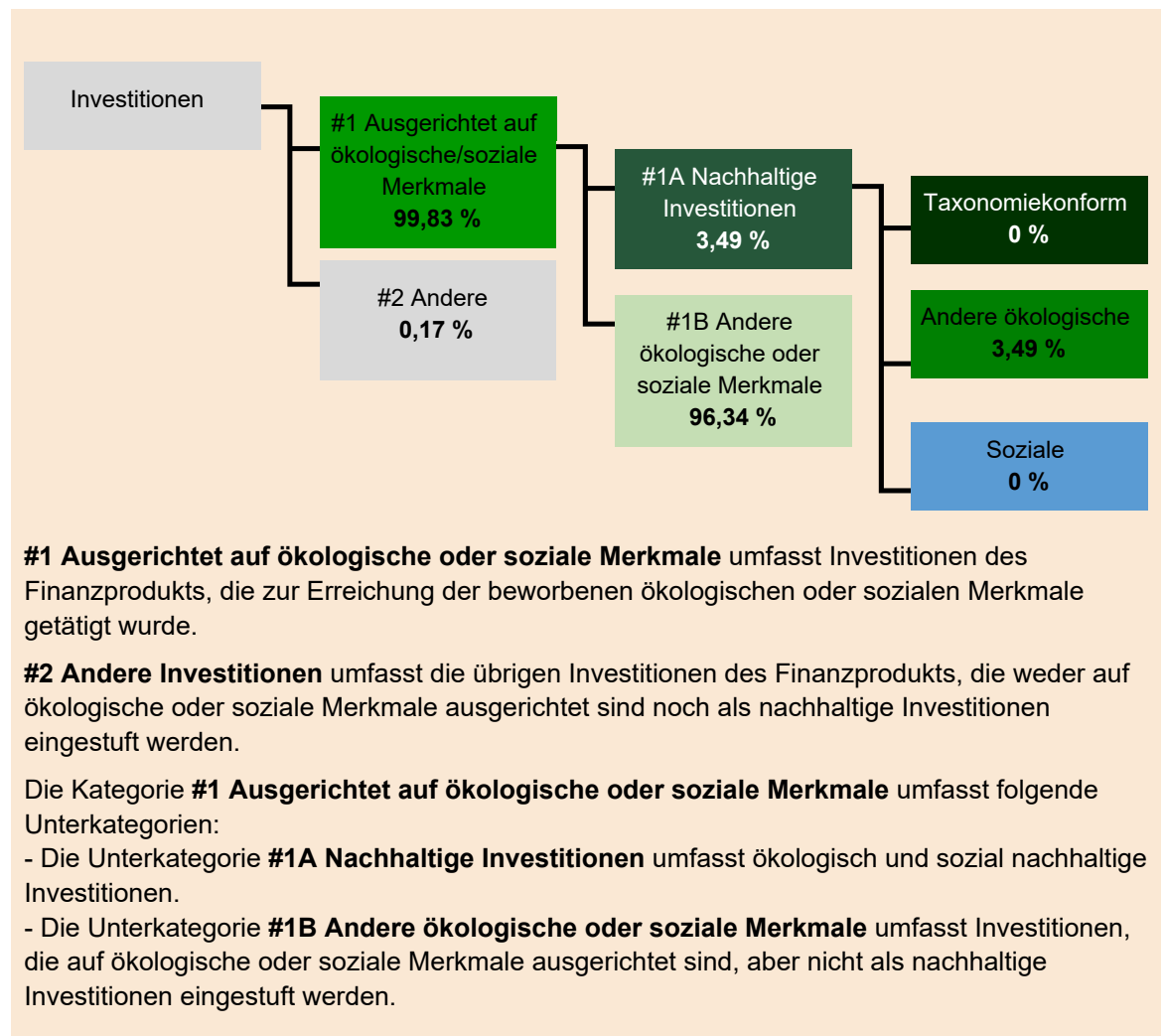
Im Folgenden ist angegeben, welcher Anteil des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewarb und welcher Anteil auf nachhaltige Investitionen entfiel.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,83 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 3,49 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Industriewerte	Transport	44,11
Technologie	Software	17,15
Kommunikation	Internet	16,61
Nichtbasiskonsumgüter	Retail	5,97
Finanzen	REITS	4,00
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	3,08
Basiskonsumgüter	Lebensmittel	2,88
Finanzen	Versicherung	2,81
Industriewerte	Elektronik	2,75
Kommunikation	Medien	0,63

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



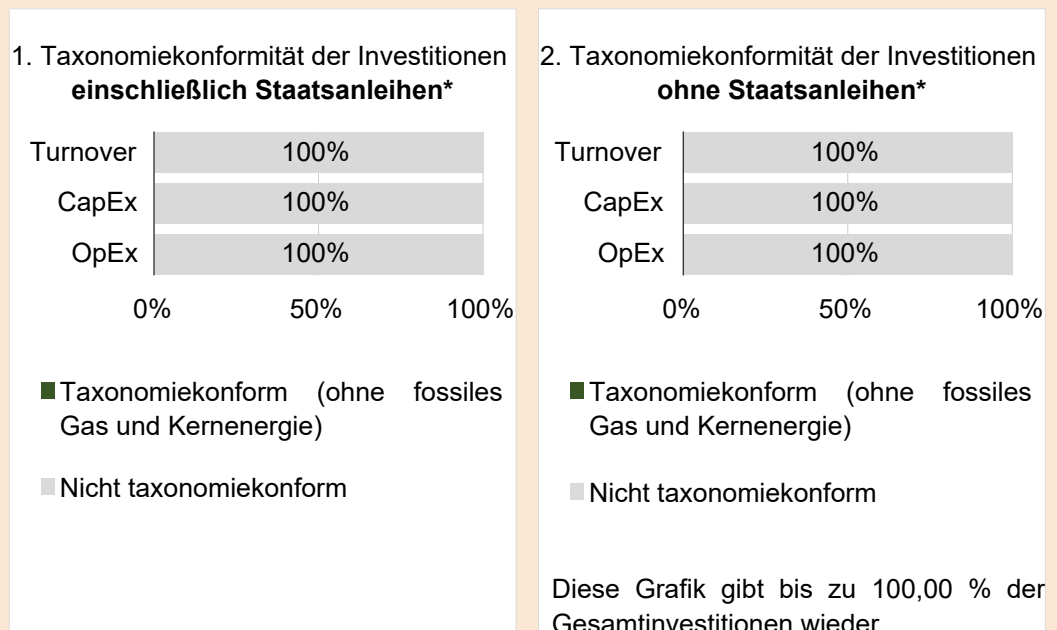
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 3,49 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds ging keine Verpflichtung ein, einen Mindestanteil an sozial nachhaltigen Anlagen zu tätigen.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen werden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds bildete den anwendbaren Index nach:

ESG-erweiterte Ausschlüsse: Der Index schloss Unternehmen aus, die (i) den UN Global Compact nicht einhielten, (ii) im Zusammenhang mit einer umstrittenen Angelegenheit standen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt waren, die schwerwiegende Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft hatten und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellten), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit verbundenen Produkt/Dienstleistung, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen, (vi) am Einzelhandel oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nichtangriffswaffen) und an Kunden aus dem militärischen Bereich bzw. der Strafverfolgung sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen, (vii) an der Gewinnung und Verstromung von Kraftwerkskohle oder der Erhöhung der Stromerzeugungskapazität von Kohle, (viii) an der Gewinnung, Produktion oder Kapazitätserhöhung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen, (ix) an der Gewinnung von Ölsand, der Exploration/Extraktion von arktischem Erdöl und Erdgas, der Gewinnung von Schiefergas oder der Kapazitätserhöhung von unkonventionellem Erdöl und Erdgas, (x) an der Produktion, dem Vertrieb, den unterstützenden Produkten oder der Kapazitätserweiterung von Kernenergie, (xi) an der Produktion, dem Einzelhandel oder den damit verbundenen Dienstleistungen/Produkten von Alkohol, (xii) am Betrieb, der Spezialausrüstung oder den unterstützenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen und (xiii) an der Produktion oder dem Vertrieb von Unterhaltung für Erwachsene beteiligt waren.

Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Beteiligung“ wurden vom Indexanbieter festgelegt und auf der Website der Solactive AG näher erläutert.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index unterscheidet sich vom relevanten breiten Marktindex durch seinen thematischen Schwerpunkt auf weltweiten Unternehmen, die aktiv an der Wertschöpfungskette im Bereich saubere Energie beteiligt sind, und stellt daher eine kleinere Untergruppe eines marktbreiten Index dar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,45 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,25 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-Ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziele könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die Nachhaltigkeitsziele

Name des Produkts:
L&G Clean Water UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800V5G7YYUFP6542

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

X Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 99,64 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0 %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Investitionsziel des Fonds war ein weltweites Engagement in Unternehmen, die im Bereich der Trinkwasserversorgung tätig sind. Der Fonds versuchte dieses Anlageziel durch die Abbildung der Wertentwicklung des Solactive Clean Water Index NTR (der „Index“) zu erreichen.

Der Index ist ein Referenzwert, der zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des

dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Fonds festgelegt wurde.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	Dieser Fonds hat keinen veröffentlichten Hauptindex, sein breit angelegtes Universum besteht jedoch aus einer Reihe von Unternehmen aus thematisch miteinander zusammenhängenden Bereichen, die von Research-Experten für den jeweiligen Bereich ausgewählt werden. Bei diesem von Solactive verwalteten Index betrug der Anteil der aufgrund der ESG-Ausschlusskriterien des Index ausgeschlossenen Beteiligungen 0,80 %. Bei Anwendung der geltenden Ausschlüsse auf das gesamte zulässige Anlageuniversum wären vorbehaltlich Liquiditäts- und Handelsbeschränkungen 4,39 % der Positionen ausgeschlossen worden.
2. Das Engagement im nachstehend dargelegten nachhaltigen Thema.	99,64 %

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?***

Der Anlageverwalter hat eine firmeneigene Methode zur Identifizierung nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ORGANO CORP NPV	Industriewerte	3,58	Japan
XYLEM INC NPV	Industriewerte	2,85	USA
BADGER METER INC USD 1.0	Industriewerte	2,30	USA
CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	Versorgungsunternehmen	2,30	USA
METSO OUTOTEC OYJ NPV	Industriewerte	2,28	Finnland
ROTORC PLC 0.5P	Industriewerte	2,25	Vereinigtes Königreich
ITRON INC	Industriewerte	2,24	USA
BENTLEY SYS INC USD 0.01	Technologie	2,22	USA
EVOQUA WATER TECHNOLOGIES CO USD0.01	Industriewerte	2,21	USA
FERGUSON PLC 10P	Nichtbasiskonsumgüter	2,19	Jersey
ROPER TECHNOLOGIES INC	Technologie	2,19	USA
IDEX CORP USD 0.01	Industriewerte	2,18	USA
SJW GROUP USD 1.042	Versorgungsunternehmen	2,18	USA
AMERICAN STATES WATER CO NPV	Versorgungsunternehmen	2,17	USA
CORE & MAIN INC-CLASS A USD 0.0100	Nichtbasiskonsumgüter	2,17	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität

Die Kriterien für **fossiles Gas** umfassen Emissionsbeschränkungen und einen Wechsel auf vollständig erneuerbare Energie oder kohlenstoffarme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie**

beinhalten die Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten,

für die es noch keine CO-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Im Folgenden wird angegeben, wie hoch der Anteil der Anlagen des Fonds ist, die im Bezugszeitraum als umweltverträgliche und sozial nachhaltige Investitionen gelten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

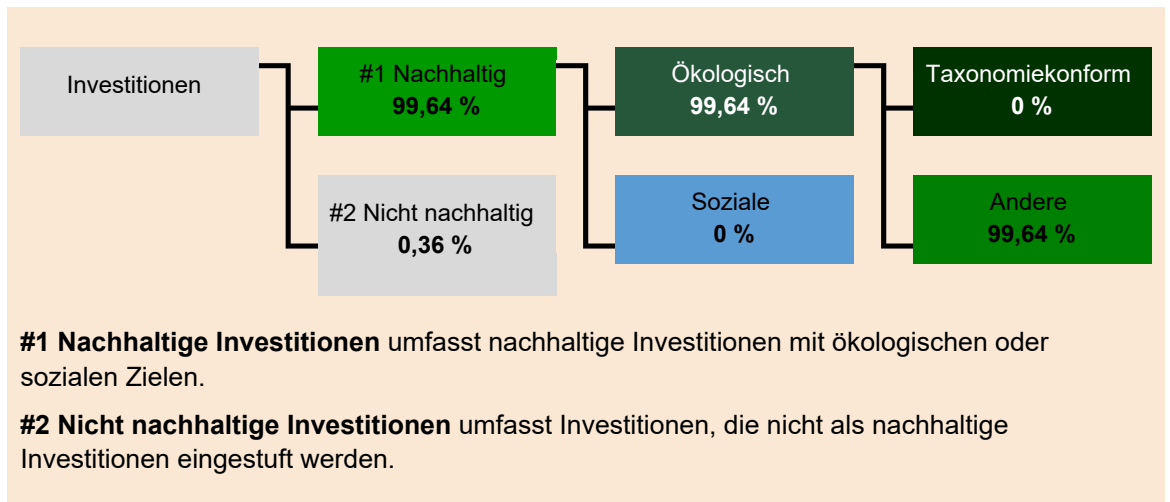
Der Fonds investierte 99,64 % seines Portfolios in Anlagen, die als nachhaltig (#1) eingestuft werden und die alle ein direktes Engagement in den Unternehmen, in die investiert wird, bieten.

Der Fonds investierte 99,64 % seines Portfolios in ökologisch nachhaltige Anlagen und 0,00 % seines Portfolios in sozial nachhaltige Anlagen.

Der verbleibende Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung des nachhaltigen Anlageziels verwendet und fiel unter Nr. 2 Nicht nachhaltig.

Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Leistungen
entsprechen.

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Versorgungsunternehmen	Wasser	23,29
Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	22,04
Industriewerte	Umweltkontrolle	10,84
Industriewerte	Elektronik	8,67
Industriewerte	Diverse Hersteller	7,48
Industriewerte	Baustoffe	4,55
Technologie	Software	4,47
Grundstoffe	Chemie	3,73
Industriewerte	Metallverarbeitung/-produkte	3,60
Nichtbasiskonsumgüter	Vertrieb/Großhandel	3,42
Industriewerte	Maschinenbau und Bergbau	2,30
Andere	Andere	5,61

Taxonomiekonform Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die Umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Fonds verpflichtete sich nicht, mehr als 0 % seines Vermögens in mit der EU-Taxonomie konforme Anlagen zu investieren. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

Ja:

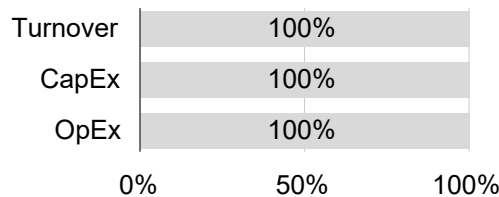
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

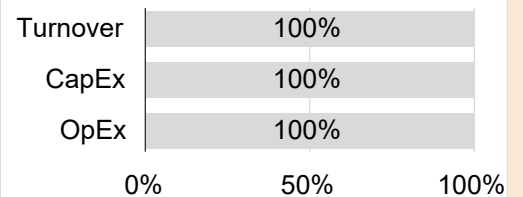
1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt bis zu 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es wird davon ausgegangen, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % beträgt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 99,64 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds ging keine Verpflichtung ein, einen Mindestanteil an sozial nachhaltigen Anlagen zu tätigen.



● **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen können Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate gehören. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Fonds verfolgte die folgende nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete:

i) **Nachhaltiges Thema:** Der Index setzte sich aus Unternehmen zusammen, die in der internationalen Clean-Water-Branche durch die Bereitstellung von technologischen, digitalen, technischen, Versorgungs- und/oder anderen Dienstleistungen aktiv waren. Um sicherzustellen, dass sich der Index aus Unternehmen zusammensetzt, die aktiv in der globalen Clean-Water-Branche tätig sind und die versuchen, zur Reinigung und Aufbereitung von Wasser beizutragen und dadurch die Verschmutzung und Verschwendung von Wasser zu verringern, die Emission von Chemikalien zu minimieren, den Anteil an unbehandeltem Abwasser zu reduzieren und die nachhaltige Bewirtschaftung von Wasserressourcen und Ökosystemen sowie die Sanierung zu fördern, berücksichtigte der Indexanbieter bei der Auswahl der Indexbestandteile die folgende Liste von Umweltfaktoren:

Für die Aufnahme in den Index kamen Unternehmen in Frage, die im internationalen Wassersektor tätig sind, wie von einem unabhängigen dritten Datenlieferanten angegeben. Der Index enthielt Unternehmen, die (a) über Fachwissen bei der Erbringung bestimmter Dienstleistungen in Bereichen wie „Technologie“, „digital“, „Versorgung“ und/oder „Technik“ für die globale saubere Wasserindustrie („wasserbezogene Dienstleistungen“) verfügen und (b) einen bestimmten Anteil ihrer Einnahmen aus der Erbringung von wasserbezogenen Dienstleistungen erzielen.

ESG-Ausschlüsse: Der Index schloss Unternehmen aus, die auf dem „ESG Exclusions Index“ gelistet waren, d. h. Unternehmen, die (i) den UNGC-Grundsätzen nicht entsprachen, (ii) in eine Kontroverse verwickelt waren (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt waren, die schwerwiegende Auswirkungen auf Umwelt und Gesellschaft hatten und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellten), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit verbundenen Produkt/Dienstleistung beteiligt waren, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit verbundenen Produkten beteiligt waren, (v) direkt oder indirekt über Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen beteiligt waren, (vi) am Verkauf oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nichtangriffswaffen) und an Kunden aus dem Bereich Militär/Gesetzesvollzug sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen beteiligt waren, (vii) an der Gewinnung von Kraftwerkskohle, der Stromerzeugung oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen beteiligt waren, (viii) an der Gewinnung und Förderung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen beteiligt waren, (ix) an der Gewinnung von Ölsand, der arktischen Erdöl- und Erdgasexploration/-gewinnung oder der Gewinnung von Schieferenergie beteiligt waren, (x) an der Gewinnung, dem Einzelhandel oder damit zusammenhängenden Dienstleistungen/Produkten von Alkohol beteiligt waren, (xi) am Betrieb, der Spezialausrüstung oder den damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen beteiligt waren und (xiii) an der Gewinnung oder dem Vertrieb von Unterhaltung für Erwachsene beteiligt waren. Diese Ausschlüsse und die Definition von „Beteiligung“ werden unter Bezugnahme auf den vom Indexanbieter veröffentlichten „ESG-Ausschlusskriterienindex“ bestimmt.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index unterscheidet sich vom relevanten breiten Marktindex aufgrund seines thematischen Engagements in Unternehmen, die aktiv in der globalen Clean-Water-Branche tätig sind und einen Beitrag zur Reinigung und Aufbereitung von Wasser leisten, um so die Wasserverschmutzung und -verschwendung zu reduzieren, die Emission von Chemikalien zu minimieren, den Anteil an unbehandeltem Abwasser zu verringern und die nachhaltige Bewirtschaftung von Wasserressourcen und Ökosystemen sowie die Abwasserreinigung zu fördern. Der Index stellt insofern eine kleinere Teilmenge eines breiten Marktindex dar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Bestandteilen, die in Einklang mit der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie standen. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,45 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,14 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziele könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die Nachhaltigkeitsziele

Name des Produkts:
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800GLU8NT72CLUX55

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

X Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 99,55 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0 %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Anlageziel des Fonds bestand darin, Engagement in der weltweiten Wasserstoffwirtschaft zu ermöglichen. Der Fonds versuchte dieses Anlageziel durch die Abbildung der Wertentwicklung des Solactive Hydrogen Economy Index NTR (der „Index“) zu erreichen.

Der Index ist ein Referenzwert, der zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des

dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Fonds festgelegt wurde.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	Dieser Fonds hat keinen veröffentlichten Hauptindex, sein breit angelegtes Universum besteht jedoch aus einer Reihe von Unternehmen aus thematisch miteinander zusammenhängenden Bereichen, die von Research-Experten für den jeweiligen Bereich ausgewählt werden. Bei diesem von Solactive verwalteten und berechneten Index betrug der Anteil der aufgrund der ESG-Ausschlusskriterien des Index ausgeschlossenen Beteiligungen 1,82 %. Bei Anwendung der geltenden Ausschlüsse auf das gesamte zulässige Anlageuniversum wären vorbehaltlich Liquiditäts- und Handelsbeschränkungen 4,39 % der Positionen ausgeschlossen worden.
2. Das Engagement im nachstehend dargelegten nachhaltigen Thema .	99,55 %

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?***

Der Anlageverwalter hat eine firmeneigene Methode zur Identifizierung nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SIEMENS ENERGY AG EUR 1.0	Industriewerte	5,14	Deutschland
BLOOM ENERGY CORP- A USD0.0001	Industriewerte	4,99	USA
WEICHAI POWER CO LTD CNY 1.0	Nichtbasiskonsumgüter	4,99	China
NIPPON SANSO HOLDINGS CORP NPV	Grundstoffe	4,84	Japan
KYOCERA CORP	Industriewerte	4,79	Japan
LINDE PLC NPV	Grundstoffe	4,79	Irland
HYUNDAI MOTOR CO KRW 5000.0	Nichtbasiskonsumgüter	4,74	Südkorea
AIR PRODS + CHEMS INC USD 1.0	Grundstoffe	4,73	USA
CUMMINS INC USD 2.5	Nichtbasiskonsumgüter	4,65	USA
AIR LIQUIDE SA EUR 5.5	Grundstoffe	4,58	Frankreich
LINDE PLC EUR0.001	Grundstoffe	4,57	Deutschland
TOYOTA MOTOR CORP NPV	Nichtbasiskonsumgüter	4,50	Japan
ORSTED A/S DKK 10.0 144A	Versorgungsunternehmen	4,46	Dänemark
PLUG POWER INC USD0.01	Energie	4,46	USA
FUELCELL ENERGY INC USD 0.0001	Energie	4,40	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität Die Kriterien für **fossiles Gas** umfassen Emissionsbeschränkungen und einen Wechsel auf vollständig erneuerbare Energie oder kohlenstoffarme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltziele leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Im Folgenden wird angegeben, wie hoch der Anteil der Anlagen des Fonds ist, die im Bezugszeitraum als umweltverträgliche und sozial nachhaltige Investitionen gelten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

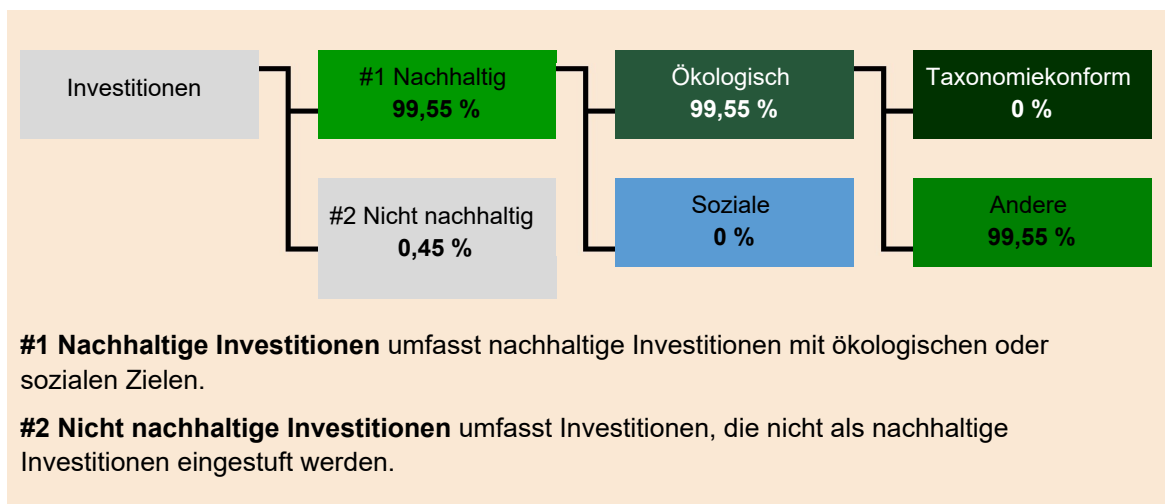
Der Fonds investierte 99,55 % seines Portfolios in Anlagen, die als nachhaltig (#1) eingestuft werden und die alle ein direktes Engagement in den Unternehmen, in die investiert wird, bieten.

Der Fonds investierte 99,55 % seines Portfolios in ökologisch nachhaltige Anlagen und 0,00 % seines Portfolios in sozial nachhaltige Anlagen.

Der verbleibende Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung des nachhaltigen Anlageziels verwendet und fiel unter Nr. 2 Nicht nachhaltig.

Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

den besten Leistungen entsprechen.

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Grundstoffe	Chemie	30,42
Energie	Alternative Energiequellen	28,57
Nichtbasiskonsumgüter Industriewerte	Automobilhersteller	15,40
Nichtbasiskonsumgüter Industriewerte	Maschinenbau und Bergbau	10,13
Nichtbasiskonsumgüter Industriewerte	Autoteile und Autozubehör	5,05
Nichtbasiskonsumgüter Industriewerte	Elektronik	4,79
Versorgungsunternehmen Industriewerte	Elektro	4,66
Finanzen Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	0,77
Finanzen Industriewerte	Investmentgesellschaften	0,11
Finanzen Industriewerte	Umweltkontrolle	0,09

Taxonomiekonform Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die Umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Fonds verpflichtete sich nicht, mehr als 0 % seines Vermögens in mit der EU-Taxonomie konforme Anlagen zu investieren. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

Ja:

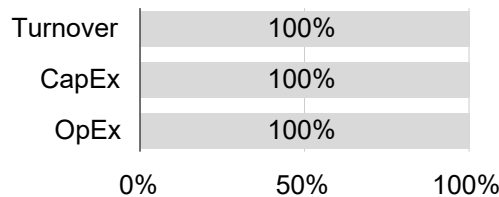
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

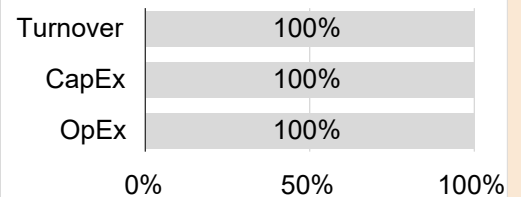
1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt bis zu 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es wird davon ausgegangen, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % beträgt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 99,55 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds ging keine Verpflichtung ein, einen Mindestanteil an sozial nachhaltigen Anlagen zu tätigen.



● **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen können Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate gehören. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Fonds verfolgte die folgende nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete:

(i) **Nachhaltiges Thema:** Der Index bestand aus Unternehmen, die aktiv in der Wertkette der Wasserstoffwirtschaft engagiert sind. Der Begriff „Wertschöpfungskette“ bezieht sich auf wertschöpfende Tätigkeiten innerhalb der Wasserstoffwirtschaft, wie etwa Energiezufuhr, Produktion, Transport, Lagerung und Endverbrauch.

ii) **ESG-Ausschlüsse:** Der Index schloss Unternehmen aus, die auf dem „ESG Exclusions Index“ gelistet waren, d. h. Unternehmen, die (i) den UNGC-Grundsätzen nicht entsprachen, (ii) in eine Kontroverse verwickelt waren (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt waren, die schwerwiegende Auswirkungen auf Umwelt und Gesellschaft hatten und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellten), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit verbundenen Produkt/Dienstleistung beteiligt waren, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit verbundenen Produkten beteiligt waren, (v) direkt oder indirekt über Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen beteiligt waren, (vi) am Verkauf oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nichtangriffswaffen) und an Kunden aus dem Bereich Militär/Gesetzesvollzug sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen beteiligt waren, (vii) an der Gewinnung von Kraftwerkskohle, der Stromerzeugung oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen beteiligt waren, (viii) an der Gewinnung und Förderung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen beteiligt waren, (ix) an der Gewinnung von Ölsand, der arktischen Erdöl- und Erdgasexploration/-gewinnung oder der Gewinnung von Schieferenergie beteiligt waren, (x) an der Gewinnung, dem Einzelhandel oder damit zusammenhängenden Dienstleistungen/Produkten von Alkohol beteiligt waren, (xi) am Betrieb, der Spezialausrüstung oder den damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen beteiligt waren und (xiii) an der Gewinnung oder dem Vertrieb von Unterhaltung für Erwachsene beteiligt waren. Diese Ausschlüsse und die Definition von „Beteiligung“ werden unter Bezugnahme auf den vom Indexanbieter veröffentlichten „ESG-Ausschlusskriterienindex“ bestimmt.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index unterscheidet sich vom relevanten breiten Marktindex durch seinen thematischen Schwerpunkt auf weltweiten Unternehmen, die aktiv an der Wertschöpfungskette im Bereich saubere Energie beteiligt sind, und stellt daher eine kleinere Untergruppe eines marktbreiten Index dar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Bestandteilen, die in Einklang mit der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie standen. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,45 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und 3 der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,86 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G Optical Technology & Photonics ESG Exclusions UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800UIX3CUVLTW4N33

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja **Nein**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 8,25 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds unterstützte die oben genannten Merkmale, indem er den Solactive EPIC Optical Technology & Photonics Index NTR (der „Index“) verfolgte, der als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale festgelegt war.

Obwohl durch die Anwendung der nachfolgend beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ökologische und soziale Merkmale beworben wurden, ist zu beachten, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Anlageziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	7,5 % * Vergleichsindex: Solactive EPIC Optical Technology & Photonics Index NTR

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
KOITO MANUFACTURING CO LTD NPV	Nichtbasiskonsumgüter	3,92	Japan
AIXTRON SE	Technologie	3,22	Deutschland
FABRINET USD 0.01	Industriewerte	3,12	Kaimaninseln
HORIBA LTD NPV	Industriewerte	3,10	Japan
JENOPTIK AG NPV	Technologie	3,04	Deutschland
NIKON CORP NPV	Industriewerte	2,99	Japan
IPG PHOTONICS CORP USD 0.0001	Technologie	2,97	USA
EVERLIGHT ELECTRONICS CO L TWD 10.0	Technologie	2,94	Taiwan
TOPCON CORP NPV	Basiskonsumgüter	2,92	Japan
HOYA CORP	Industriewerte	2,90	Japan
HAMAMATSU PHOTONICS KK NPV	Technologie	2,89	Japan
LUNA INNOVATIONS INC USD 0.001	Kommunikation	2,85	USA
GENTEX CORP USD 0.06	Nichtbasiskonsumgüter	2,81	USA
COGNEX CORP USD 0.002	Industriewerte	2,80	USA
USHIO INC NPV	Basiskonsumgüter	2,79	Japan

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

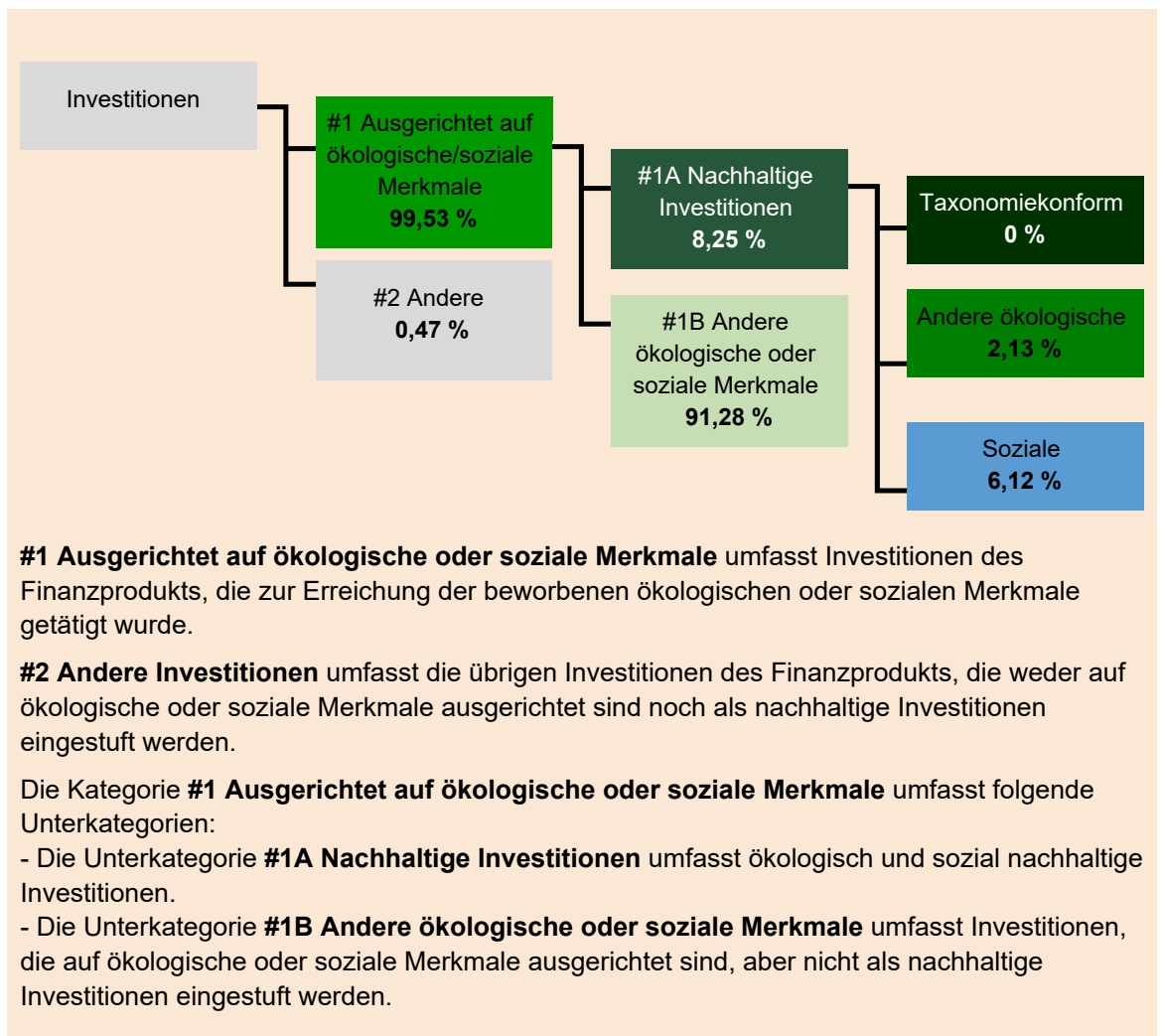
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,53 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 8,25 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Technologie	Halbleiter	20,23
Industriewerte	Elektronik	13,51
Technologie	Computer	12,56
Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	9,09
Industriewerte	Diverse Hersteller	8,42
Industriewerte	Elektroteile und -ausrüstung	8,13
Basiskonsumgüter	Gesundheitsprodukte	8,04
Nichtbasiskonsumgüter	Autoteile und Autozubehör	7,28
Kommunikation	Telekommunikation	5,46
Basiskonsumgüter	Haushaltsprodukte/-waren	2,83
Industriewerte	Handwerkzeuge und Werkzeugmaschinen	2,64
Andere	Andere	1,82

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



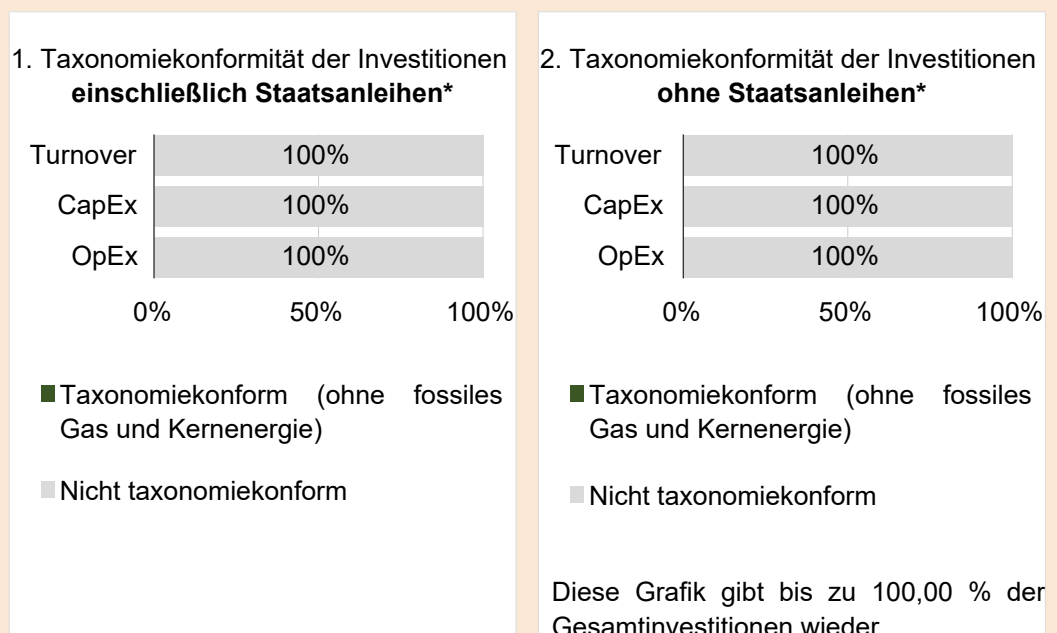
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 2,13 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 6,12 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen können für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet werden. Derivate können auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht

wurde.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds bildete den anwendbaren Index nach:

ESG-erweiterte Ausschlüsse: Der Index schloss Unternehmen aus, die (i) den UN Global Compact nicht einhalten, (ii) im Zusammenhang mit einer umstrittenen Angelegenheit stehen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt sind, die schwerwiegende Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft haben und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellen), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit verbundenen Produkt/Dienstleistung, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen, (vi) am Einzelhandel oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nichtangriffswaffen) und an Kunden aus dem militärischen Bereich bzw. der Strafverfolgung sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen, (vii) an der Gewinnung und Verstromung von Kraftwerkskohle oder der Erhöhung der Stromerzeugungskapazität daraus, (viii) an der Gewinnung, Produktion oder Kapazitätserhöhung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen, (ix) an der Gewinnung von Ölsand, der Exploration/Extraktion von arktischem Erdöl und Erdgas, der Gewinnung von Schiefergas oder der Kapazitätserhöhung von unkonventionellem Erdöl und Erdgas, (x) an der Produktion, dem Vertrieb, den unterstützenden Produkten oder der Kapazitätserweiterung von Kernenergie, (xi) an der Produktion, dem Einzelhandel oder den damit verbundenen Dienstleistungen/Produkten von Alkohol, (xii) am Betrieb, der Spezialausrüstung oder den unterstützenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen und (xiii) an der Produktion oder dem Vertrieb von Unterhaltung für Erwachsene beteiligt sind.

Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Beteiligung“ wurden vom Indexanbieter festgelegt und auf der Website der Solactive AG <https://www.solactive.com/indices/?index=DE000SL0F799> näher erläutert.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,35 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,06 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G Metaverse ESG Exclusions UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800Q93EXPCRQN6419

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 37,63 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die vorstehend erwähnten Merkmale durch die Abbildung des iStoxx Access Metaverse Index („Index“), der als Referenzwert zwecks des Erreichens der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale diente. Obwohl durch die Anwendung der nachfolgend beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ökologische und soziale Merkmale beworben wurden, ist zu beachten, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Anlageziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des Index, der in Unternehmen engagiert ist, die nicht den Ausschlusskriterien entsprechen, die nachstehend dargelegt werden	0 % des Index sind in Unternehmen investiert, die gemäß den Ausschlusskriterien aus dem Index ausgeschlossen sind.
2. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	Der Anteil der Positionen, die aufgrund der Ausschlusskriterien aus dem Index des Fonds ausgeschlossen wurden, beträgt 1,79 % Der Anteil der Positionen, die aufgrund der Ausschlusskriterien aus dem breiteren Anlageuniversum ausgeschlossen wurden, beträgt 8,25 %

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NVIDIA CORP USD 0.001	Technologie	5,80	USA
BROADCOM INC NPV	Technologie	5,66	USA
META PLATFORMS INC USD 0.000006	Kommunikation	5,37	USA
MICROSOFT CORP USD 0.0000125	Technologie	5,23	USA
SAMSUNG ELECTRONICS CO LT KRW 100.0	Technologie	5,07	Südkorea
ADVANCED MICRO DEVICES INC USD 0.01	Technologie	4,89	USA
ADOBE INC USD0.0001	Technologie	4,78	USA
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUF TWD 10.0	Technologie	4,68	Taiwan
QUALCOMM INC USD 0.0001	Technologie	4,49	USA
EQUINIX IN COM USD0.001	Finanzen	4,24	USA
MICRON TECHNOLOGY INC USD 0.1	Technologie	4,17	USA
PALO ALTO NETWORKS INC USD 0.0001	Kommunikation	3,77	USA
AUTODESK INC USD 0.01	Technologie	2,92	USA
MARVELL TECHNOLOGY INC USD 0.002	Technologie	2,63	USA
FORTINET I USD 0.001	Technologie	2,61	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

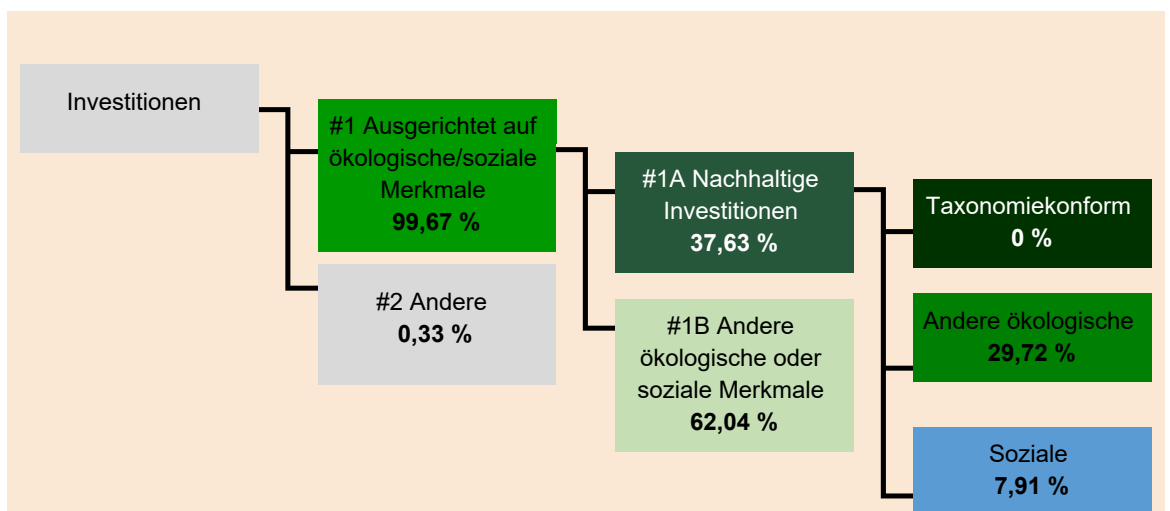
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,67 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 37,63 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurde.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Technologie	Halbleiter	41,00
Technologie	Software	24,63
Kommunikation	Internet	12,68
Kommunikation	Telekommunikation	6,96
Technologie	Computer	4,43
Finanzen	REITS	4,21
Industriewerte	Elektronik	2,41
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	2,24
Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	0,78
Finanzen	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	0,65

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



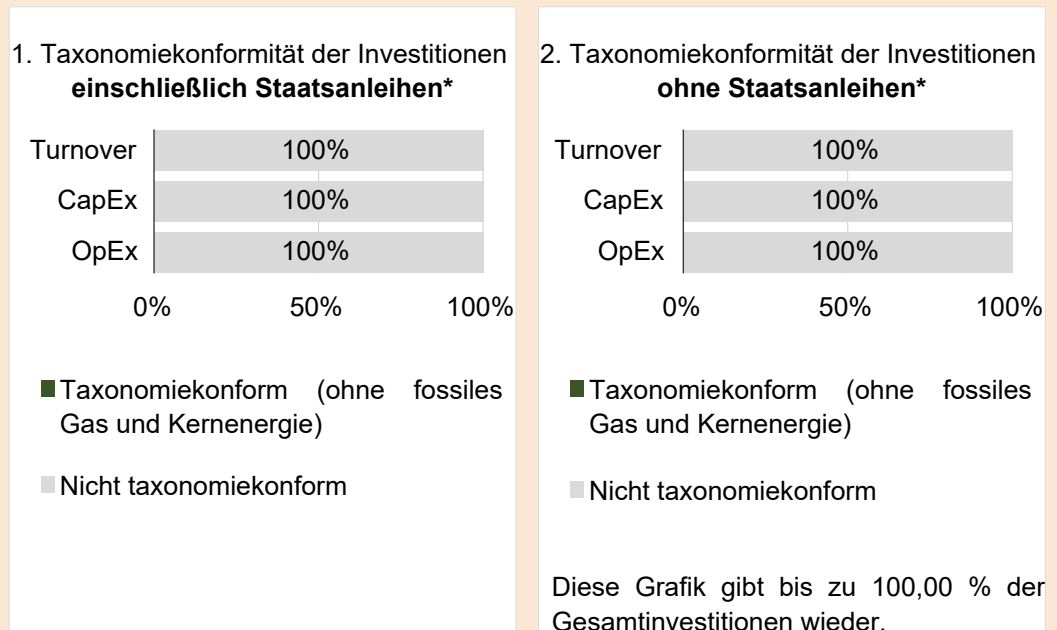
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 29,72 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 7,91 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen können für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet werden. Derivate wurden auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wurde.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds bildete den Index ab, der Unternehmen ausschloss, die:

(i) gegen weltweit anerkannte Normen und Standards verstießen oder Gefahr liefen, dagegen zu verstoßen, wie etwa gegen die im United Nations Global Compact (UNGC), den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) verankerten Normen und Standards,

(i) an umstrittenen Waffen beteiligt waren bzw.

(iii) an der Produktion von Tabak, konventionellem Öl und Gas, Kraftwerkskohle und Atomkraft beteiligt waren.

Diese Ausschlüsse wurden durch Bezugnahme auf die Index-Methode festgelegt, die auf der Website von Stoxx Ltd abgerufen werden kann.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,35 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,08 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziele könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die Nachhaltigkeitsziele

Name des Produkts:
L&G Clean Energy UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800YPKIE4MZMQHK38

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

X Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 97,13 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0 %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Investitionsziel des Fonds war ein weltweites Engagement in Unternehmen aus dem Bereich saubere Energie. Der Fonds versuchte dieses Anlageziel durch die Abbildung der Wertentwicklung des Solactive Clean Energy Index NTR (der „Index“) zu erreichen.

Der Index ist ein Referenzwert, der zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds festgelegt wurde.

dieses Finanzprodukts erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde;	Dieser Fonds hat keinen veröffentlichten Hauptindex, sein breit angelegtes Universum besteht jedoch aus einer Reihe von Unternehmen aus thematisch miteinander zusammenhängenden Bereichen, die von Research-Experten für den jeweiligen Bereich ausgewählt werden. Bei diesem von Solactive verwalteten und berechneten Index betrug der Anteil der aufgrund der ESG-Ausschlusskriterien des Index ausgeschlossenen Beteiligungen 0,68 %. Bei Anwendung der geltenden Ausschlüsse auf das gesamte zulässige Anlageuniversum wären vorbehaltlich Liquiditäts- und Handelsbeschränkungen 4,39 % der Positionen ausgeschlossen worden.
2. Das Engagement im nachstehend dargelegten nachhaltigen Thema .	97,13 %

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?***

Der Anlageverwalter hat eine firmeneigene Methode zur Identifizierung nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SMA SOLAR TECHNOLOGY AG NPV	Industriewerte	2,98	Deutschland
SAIPEM SPA NPV	Energie	2,54	Italien
ENERGIA INNOVACION Y DESA EUR 0.025	Energie	2,52	Spanien
NEOEN SA EUR 2.0 144A	Energie	2,51	Frankreich
PNE AG	Energie	2,45	Deutschland
Engie EUR1	Versorgungsunternehmen	2,39	Frankreich
MARUBENI CORP NPV	Nichtbasiskonsumgüter	2,36	Japan
MITSUBISHI CORP NPV	Nichtbasiskonsumgüter	2,36	Japan
IBERDROLA SA EUR 0.75	Versorgungsunternehmen	2,35	Spanien
SCHNEIDER ELECTRIC SE EUR 4.0	Industriewerte	2,32	Frankreich
ANDRITZ AG NPV	Industriewerte	2,28	Österreich
FIRST SOLAR INC USD 0.001	Energie	2,28	USA
SIEMENS ENERGY AG EUR 1.0	Industriewerte	2,28	Deutschland
AMERESCO INC USD 0.0001	Versorgungsunternehmen	2,25	USA
FUGRO NV EUR 0.05	Energie	2,23	Niederlande

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität Die Kriterien für **fossiles Gas** umfassen Emissionsbeschränkungen und einen Wechsel auf vollständig erneuerbare Energie oder kohlenstoffarme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Im Folgenden wird angegeben, wie hoch der Anteil der Anlagen des Fonds ist, die im Bezugszeitraum als umweltverträgliche und sozial nachhaltige Investitionen gelten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

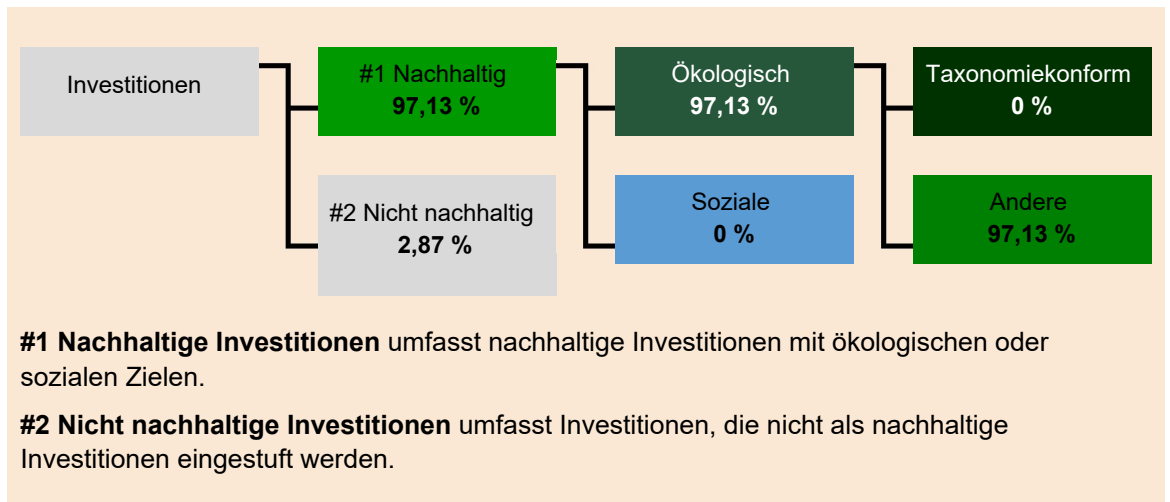
Der Fonds investierte 97,13 % seines Portfolios in Anlagen, die als nachhaltig (#1) eingestuft werden und die alle ein direktes Engagement in den Unternehmen, in die investiert wird, bieten.

Der Fonds investierte 97,13 % seines Portfolios in ökologisch nachhaltige Anlagen und 0,00 % seines Portfolios in sozial nachhaltige Anlagen.

Der verbleibende Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung des nachhaltigen Anlageziels verwendet und fiel unter Nr. 2 Nicht nachhaltig.

Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Leistungen entsprechen.

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Energie	Alternative Energiequellen	34,42
Versorgungsunternehmen	Elektro	23,93
Industriewerte	Bau- und Ingenieurwesen	8,57
Industriewerte	Elektroteile und -ausrüstung	7,43
Nichtbasiskonsumgüter	Vertrieb/Großhandel	5,69
Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	4,34
Energie	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	4,16
Industriewerte	Maschinenbau und Bergbau	3,77
Nichtbasiskonsumgüter	Autoteile und Autozubehör	2,15
Industriewerte	Umweltkontrolle	2,14
Nichtbasiskonsumgüter	Automobilhersteller	2,13
Andere	Andere	1,28

Taxonomiekonform Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die Umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Fonds verpflichtete sich nicht, mehr als 0 % seines Vermögens in mit der EU-Taxonomie konforme Anlagen zu investieren. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

Ja:

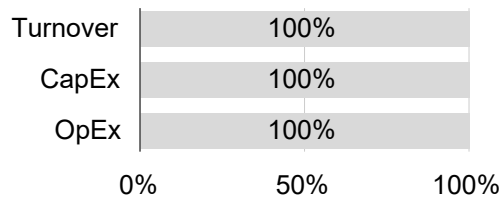
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

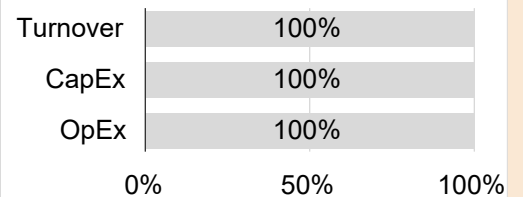
1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt bis zu 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es wird davon ausgegangen, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % beträgt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 97,13 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds ging keine Verpflichtung ein, einen Mindestanteil an sozial nachhaltigen Anlagen zu tätigen.



● **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen können Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate gehören. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen werden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigt der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Fonds verfolgte die folgende nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie, indem er den Index nachbildete:

(i) **Nachhaltiges Thema:** Der Index setzte sich aus Unternehmen zusammen, die aktiv in der Wertschöpfungskette der globalen umweltfreundlichen Energiebranche tätig waren. Der Begriff „Wertschöpfungskette“ bezieht sich auf alle wertschöpfenden Aktivitäten innerhalb der globalen umweltfreundlichen Energiewirtschaft, beginnend mit der Gewinnung von Rohstoffen und endend mit der Produktion von fertigen Produkten.

ESG-Ausschlüsse: Der Index schloss Unternehmen aus, die Bestandteile des „ESG-Ausschlusskriterienindex“ sind, d. h. Unternehmen, die (i) den UN Global Compact nicht einhielten, (ii) im Zusammenhang mit einer Kontroverse standen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt waren, die schwerwiegende Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft hatten und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellten), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder damit verbundenen Produkten/Dienstleistungen, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen, (vi) an der Gewinnung von Kraftwerkskohle, der Stromerzeugung daraus oder an damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen und (vii) an der Produktion von konventionellem Öl und Gas beteiligt waren.

Diese Ausschlüsse und die Definition von „Beteiligung“ wurden unter Bezugnahme auf den vom Indexanbieter veröffentlichten „ESG-Ausschlusskriterienindex“ bestimmt.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index unterscheidet sich vom relevanten breiten Marktindex durch seinen thematischen Schwerpunkt auf weltweiten Unternehmen, die aktiv an der Wertschöpfungskette im Bereich saubere Energie beteiligt sind, und stellt daher eine kleinere Untergruppe eines marktbreiten Index dar.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Bestandteilen, die in Einklang mit der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie standen. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,35 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 5,66 %.

Der gemeldete Tracking Error übersteigt den geschätzten (Ex-ante) Tracking Error aufgrund einer Kapitalmaßnahme, die zwischen Ende Juni und Mitte Juli 2022 stattfand. Außerhalb des Zeitraums dieser Kapitalmaßnahme betrug der jährliche Tracking Error 0,14 %.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziele könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G Asia Pacific ex Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800MXB1N5CK2DG981

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

X Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0 %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die Nachhaltigkeitsziele

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Anlageziel des Fonds bestand darin, ein CO2-armes Engagement am Aktienmarkt für große und mittelgroße Unternehmen in den Industrieländern des pazifischen Raumes (ohne Japan) zu bieten. Der Fonds versuchte, sein Anlageziel zu erreichen, indem er die Wertentwicklung des Foxyberry Sustainability Consensus Pacific ex Japan Total Return Index (der „Index“) nachbildete.

dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Der Index wurde so zusammengestellt, dass er die Mindestanforderungen der Verordnung (EU) 2019/2089 hinsichtlich auf das Übereinkommen von Paris abgestimmter EU-Referenzwerte (die „PAB-Verordnung“) erfüllt.

Der Index wurde als Referenzwert zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds festgelegt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Die Bewertung der Treibhausgasintensität des Index verglichen mit der Treibhausgasintensität der zugrundeliegenden Universums;	78 %
2. Der Anteil des Index, der in Emittenten engagiert ist, die nicht den Ausschlusskriterien entsprechen, die nachstehend dargelegt werden;	0 % des Index sind in Emittenten investiert, die gemäß den Ausschlusskriterien aus dem Index ausgeschlossen sind.
3. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindexes, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde.	21,5 % *Vergleichsindex: MSCI AC Asia Pacific Excluding Japan Index

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden („Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen““). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?“ sowie gemäß den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. Beispielsweise verwendet der Fonds den Indikator „THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird“, um wichtige nachteilige Auswirkungen in Bezug auf Treibhausgasemissionen zu identifizieren. Zudem zieht der Fonds die durch die Implementierung der Paris-abgestimmten EU-Referenzwerte ermittelten Auswirkungen wie unten beschrieben in Betracht und ergreift entsprechende Maßnahmen. Der Fonds berücksichtigt die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen über die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 1: THG-Emissionen
PAI 2: CO-Fußabdruck
PAI 3: THG-Emissionsintensität der Unternehmen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AIA GROUP LTD NPV	Finanzen	4,83	Hongkong
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL NPV	Finanzen	4,63	Australien
CSL LTD AUD NPV	Basiskonsumgüter	3,70	Australien
WOOLWORTHS GROUP LTD NPV	Basiskonsumgüter	3,66	Australien
TRANSURBAN GROUP	Basiskonsumgüter	3,56	Australien
WESFARMERS LTD NPV	Nichtbasiskonsumgüter	2,93	Australien
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD NPV	Finanzen	2,51	Australien
WESTPAC BANKING CORP NPV	Finanzen	2,16	Australien
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR NPV	Finanzen	2,04	Hongkong
ANZ GROUP HOLDINGS LTD AUD NPV	Finanzen	1,95	Australien
ANZ GROUP HOLDINGS LTD NPV	Finanzen	1,88	Australien
COLES GROUP LTD NPV	Basiskonsumgüter	1,88	Australien
DBS GROUP HOLDINGS LTD NPV	Finanzen	1,85	Singapur
NEWCREST MINING LTD AUD NPV	Grundstoffe	1,79	Australien
MACQUARIE GP LTD NPV	Finanzen	1,78	Australien

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität Die Kriterien für **fossiles Gas** umfassen Emissionsbeschränkungen und einen Wechsel auf vollständig erneuerbare Energie oder kohlenstoffarme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die

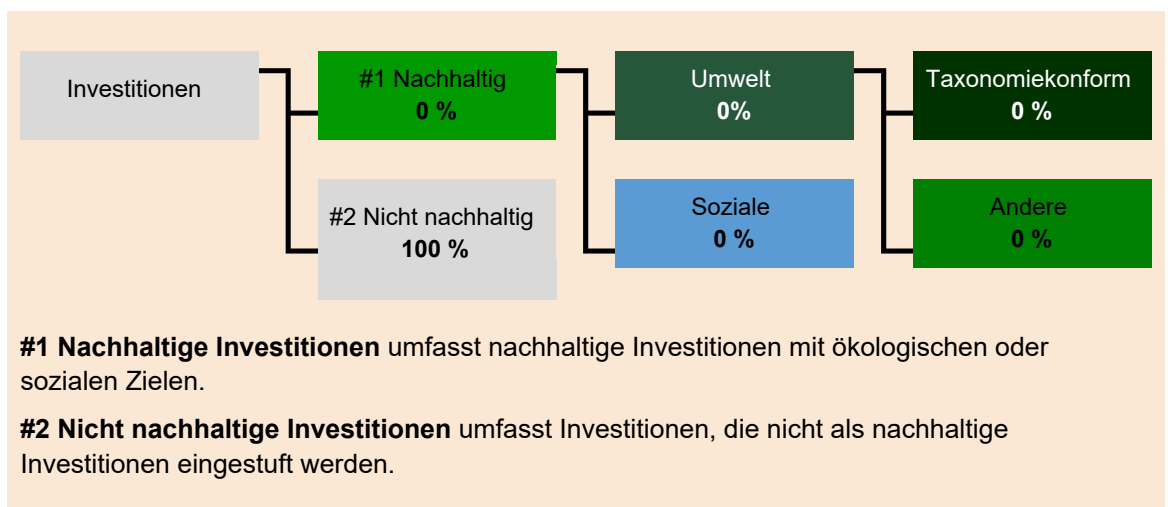
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Im Folgenden wird angegeben, wie hoch der Anteil der Anlagen des Fonds ist, die im Bezugszeitraum als umweltverträgliche und sozial nachhaltige Investitionen gelten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 0,00 % seines Portfolios in Investitionen, die gemäß der Definition des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen (#1) gelten. Der verbleibende Teil der Investitionen fiel unter #2 Nicht nachhaltig, wurde aber dennoch gehalten, um ein nachhaltiges Anlageziel des Fonds (geringe Kohlenstoffemissionen) zu erreichen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Sektor	Teilssektor	In % der Vermögenswerte
Finanzen	Banken	17,64
Finanzen	REITS	9,93
Basiskonsumgüter	Lebensmittel	7,64
Finanzen	Versicherung	6,20
Grundstoffe	Bergbau	6,09
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	6,07
Finanzen	Immobilien	5,81
Nichtbasiskonsumgüter	Retail	4,10
Basiskonsumgüter	Biotechnologie	3,68
Basiskonsumgüter	Gesundheitsprodukte	2,85
Finanzen	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	2,82
Andere	Andere	27,16

den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonform Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben**

(CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben**

(OpEx), die die Umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, der Unternehmen, in die investiert wird, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

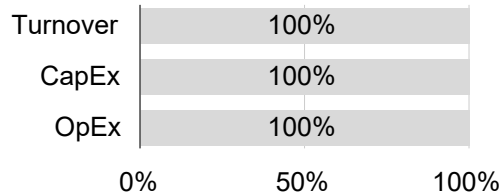
Der Fonds verpflichtete sich nicht, mehr als 0 % seines Vermögens in mit der EU-Taxonomie konforme Anlagen zu investieren. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

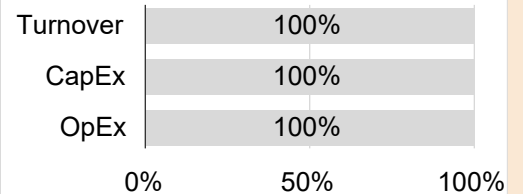
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt bis zu 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es wird davon ausgegangen, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % beträgt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 0,00 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 0,00 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den „nicht nachhaltigen“ Anlagen gehörten Aktienwerte, die gehalten wurden, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds zu erreichen. Die ökologischen und sozialen Mindestschutzmaßnahmen, die Teil der im Fonds umgesetzten DNSH-Bewertung sind, beziehen sich auf die vom Index angewendeten Ausschlusskriterien.

Zu den sonstigen Anlagen können Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate gehören. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Fonds setzte die folgende nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie um, indem er den Index abbildete, der den in der Verordnung (EU) 2020/1818 zur Änderung der Verordnung (EU) 2016/1011 des europäischen Parlaments und des Rates festgelegten Anforderungen an Paris-abgestimmte EU-Referenzwerte hinsichtlich der Mindeststandards für den klimabedingten Wandel entspricht und daher als auf das Übereinkommen von Paris abgestimmter EU-Referenzwert bezeichnet wird. Der Index wurde aus dem zugrundeliegenden Universum aufgebaut, indem bestimmte Ausschlüsse angewendet werden, um die Ausschluss- und Dekarbonisierungskurs gemäß dem Übereinkommen von Paris zu erfüllen oder zu überschreiten, und zwar zusammen mit weiteren Ausschlüssen, wie im Abschnitt „Indexbeschreibung“ des Nachtrags zum Fonds weiter dargelegt.

Ausschlussrichtlinien auf der Grundlage der PAB-Verordnung:

- (i) An Tätigkeiten hinsichtlich umstrittener Waffen beteiligte Unternehmen;
- (ii) Am Anbau und der Produktion von Tabak beteiligte Unternehmen;
- (iii) Unternehmen, welche die Prinzipien des United Nations Global Compact (UNGC) oder der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen verletzen;
- (iv) Unternehmen, die einen über den vom Indexanbieter bestimmten Grenzwert hinausgehenden Anteil ihrer Umsätze aus einer der folgenden Tätigkeiten erzielen:
 - a. Erschließung, Abbau, Verarbeitung, Vertrieb oder Weiterverarbeitung von Steinkohle und Braunkohle;
 - b. Erschließung, Abbau, Verarbeitung, Vertrieb oder Weiterverarbeitung von fossilen Brennstoffen;
 - c. Erschließung, Abbau, Verarbeitung, Vertrieb oder Weiterverarbeitung von gasförmigen Brennstoffen;
 - d. Stromerzeugung mit einer über das vom Indexanbieter festgelegte Maß hinausgehenden Intensität eines Treibhausgases („THG“).

Weitere Ausschlussrichtlinien:

- (i) Unternehmen, deren Umsatz aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und deren Verkauf an externe Parteien stammt;
- (ii) Unternehmen, deren Umsatz aus unkonventionellem Öl und Gas stammt;
- (iii) Unternehmen mit wesentlichen verlorenen Investitionen
- (iv) Unternehmen, die einen über den vom Indexanbieter festgelegten Grenzwert hinausgehenden Anteil ihrer Umsätze aus ökologisch schädlichen Tätigkeiten erzielen (wie im Dokument „Index-Methode“ festgelegt);
- (v) Unternehmen, welche die Mindeststandards bezüglich Geschäftspraktiken nicht einhalten, wie vom Indexanbieter festgelegt.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index unterschied sich vom breiten Marktindex aufgrund der Anwendung der vorstehend beschriebenen Ausschlüsse und der Erfüllung oder des Übertreffens des Dekarbonisierungskurses gemäß dem Übereinkommen von Paris, wodurch aufgrund der angewendeten Ausschlüsse und Gewichtungen ein kleineres und anders gewichtetes Anlageuniversum entsteht.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Bestandteilen, die in Einklang mit der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie standen. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,30 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,11 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-Ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziele könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die Nachhaltigkeitsziele

Name des Produkts:
L&G Europe ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800D92A2YGDJ41K46

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

X Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 6,31 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 18,74 %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Anlageziel des Fonds besteht in einem Engagement in Aktien kohlenstoffarmer europäischer Unternehmen mit geringer, mittlerer und hoher Markkapitalisierung. Der Fonds versuchte, sein Anlageziel zu erreichen, indem er die Wertentwicklung des Foxyberry Sustainability Consensus Europe Total Return Index (der „Index“) nachbildete. Der Index ist so zusammengestellt, dass er die Mindestanforderungen der Verordnung (EU) 2019/2089 hinsichtlich auf das Übereinkommen von Paris abgestimmter EU-Referenzwerte (die

dieses Finanzprodukts erreicht werden.

„PAB-Verordnung“) erfüllt.

Der Index wurde als Referenzwert zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds festgelegt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Die Bewertung der Treibhausgasintensität des Index verglichen mit der Treibhausgasintensität der zugrundeliegenden Universums;	72 %
2. Der Anteil des Index, der in Emittenten engagiert ist, die nicht den Ausschlusskriterien entsprechen, die nachstehend dargelegt werden;	0 % des Index sind in Emittenten investiert, die gemäß den Ausschlusskriterien aus dem Index ausgeschlossen sind.
3. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	16 % *Vergleichsindex: Stoxx Europe 600 Index

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden („Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen““). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?“ sowie gemäß den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. Beispielsweise verwendet der Fonds den Indikator „THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird“, um wichtige nachteilige Auswirkungen in Bezug auf Treibhausgasemissionen zu identifizieren. Zudem zieht der Fonds die durch die Implementierung der Paris-abgestimmten EU-Referenzwerte ermittelten Auswirkungen wie unten beschrieben in Betracht und ergreift entsprechende Maßnahmen. Der Fonds berücksichtigt die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen über die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 1: THG-Emissionen
PAI 2: CO-Fußabdruck
PAI 3: THG-Emissionsintensität der Unternehmen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NESTLE SA CHF 0.1	Basiskonsumgüter	4,01	Schweiz
ASML HOLDING NV EUR 0.09	Technologie	2,90	Niederlande
NOVO NORDISK A/S DKK 0.2	Basiskonsumgüter	2,72	Dänemark
ROCHE HOLDING AG NPV	Basiskonsumgüter	2,69	Schweiz
ASTRAZENECA PLC USD 0.25	Basiskonsumgüter	2,50	Vereinigtes Königreich
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON EUR 0.3 RFD	Nichtbasiskonsumgüter	2,50	Frankreich
NOVARTIS AG CHF 0.5	Basiskonsumgüter	2,33	Schweiz
LINDE PLC EUR0.001	Grundstoffe	1,97	Deutschland
HSBC HOLDINGS PLC GBP 0.5000	Finanzen	1,60	Vereinigtes Königreich
UNILEVER PLC 3.1111P	Basiskonsumgüter	1,54	Vereinigtes Königreich
SAP SE NPV	Technologie	1,39	Deutschland
SANOFI	Basiskonsumgüter	1,32	Frankreich
SIEMENS AG NPV	Industriewerte	1,26	Deutschland
DIAGEO PLC 28.93518P	Basiskonsumgüter	1,21	Vereinigtes Königreich
L'OREAL EUR0.2	Basiskonsumgüter	1,15	Frankreich

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität Die Kriterien für **fossiles Gas** umfassen Emissionsbeschränkungen und einen Wechsel auf vollständig erneuerbare Energie oder kohlenstoffarme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten

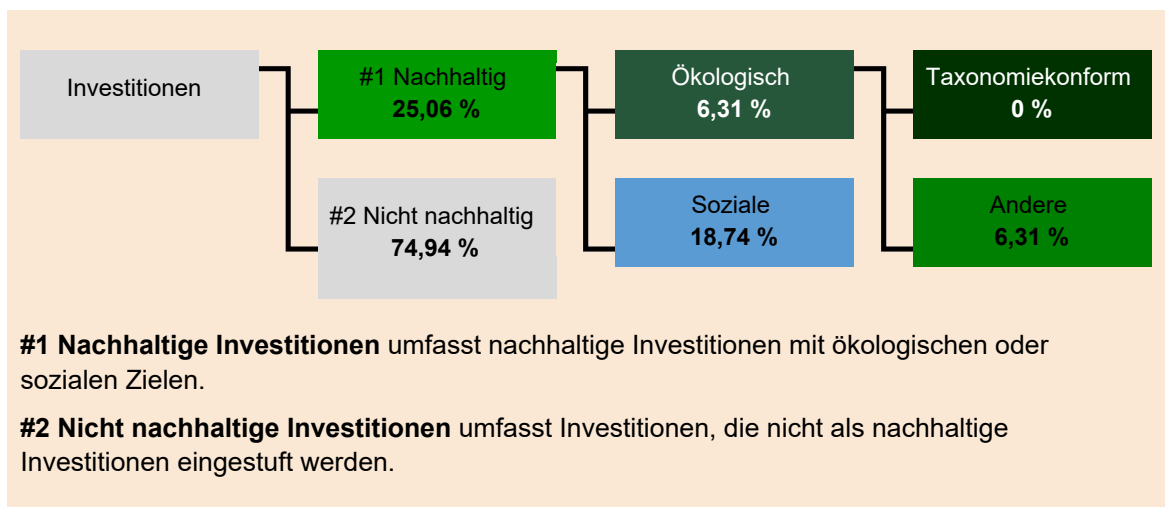
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Im Folgenden wird angegeben, wie hoch der Anteil der Anlagen des Fonds ist, die im Bezugszeitraum als umweltverträgliche und sozial nachhaltige Investitionen gelten.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Fonds investierte 25,06 % seines Portfolios in Investitionen, die gemäß der Definition des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen (#1) gelten. Der verbleibende Teil der Investitionen fiel unter #2 Nicht nachhaltig, wurde aber dennoch gehalten, um ein nachhaltiges Anlageziel des Fonds (geringe Kohlenstoffemissionen) zu erreichen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Basiskonsumgüter	Pharmazeutische Produkte	13,82
Finanzen	Banken	10,37
Finanzen	Versicherung	6,18
Basiskonsumgüter	Lebensmittel	6,14
Technologie	Halbleiter	4,46
Nichtbasiskonsumgüter	Bekleidung	4,40
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	3,53
Basiskonsumgüter	Kosmetika/Körperpflege	3,29
Basiskonsumgüter	Getränke	3,09
Kommunikation	Telekommunikation	3,05
Grundstoffe	Chemie	2,98
Andere	Andere	38,70

Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die Umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Fonds verpflichtete sich nicht, mehr als 0 % seines Vermögens in mit der EU-Taxonomie konforme Anlagen zu investieren. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

Ja:

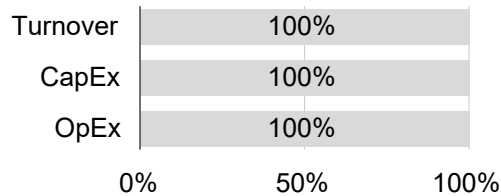
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

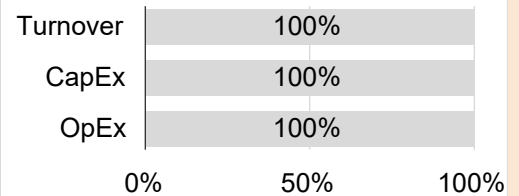
1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt bis zu 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es wird davon ausgegangen, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % beträgt.



● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 6,31 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.

● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 18,74 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.

● **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den „nicht nachhaltigen“ Anlagen gehörten Aktienwerte, die gehalten wurden, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds zu erreichen. Die ökologischen und sozialen Mindestschutzmaßnahmen, die Teil der im Fonds umgesetzten DNSH-Bewertung sind, beziehen sich auf die vom Index angewendeten Ausschlusskriterien.

Zu den sonstigen Anlagen können Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate gehören. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen werden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Fonds setzte die folgende nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie um, indem er den Index abbildete, der den in der Verordnung (EU) 2020/1818 zur Änderung der Verordnung (EU) 2016/1011 des europäischen Parlaments und des Rates festgelegten Anforderungen an Paris-abgestimmte EU-Referenzwerte hinsichtlich der Mindeststandards für den klimabedingten Wandel entspricht und daher als auf das Übereinkommen von Paris abgestimmter EU-Referenzwert bezeichnet wird. Der Index wurde aus dem zugrundeliegenden Universum aufgebaut, indem bestimmte Ausschlüsse angewendet werden, um die Ausschluss- und Dekarbonisierungskurs gemäß dem Übereinkommen von Paris zu erfüllen oder zu überschreiten, und zwar zusammen mit weiteren Ausschlüssen, wie im Abschnitt „Indexbeschreibung“ des Nachtrags zum Fonds weiter dargelegt.

Ausschlussrichtlinien auf der Grundlage der PAB-Verordnung:

- (i) An Tätigkeiten hinsichtlich umstrittener Waffen beteiligte Unternehmen;
- (ii) Am Anbau und der Produktion von Tabak beteiligte Unternehmen;
- (iii) Unternehmen, welche die Prinzipien des United Nations Global Compact (UNGC) oder der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen verletzen;
- (iv) Unternehmen, die einen über den vom Indexanbieter bestimmten Grenzwert hinausgehenden Anteil ihrer Umsätze aus einer der folgenden Tätigkeiten erzielen:
 - a. Erschließung, Abbau, Verarbeitung, Vertrieb oder Weiterverarbeitung von Steinkohle und Braunkohle;
 - b. Erschließung, Abbau, Verarbeitung, Vertrieb oder Weiterverarbeitung von fossilen Brennstoffen;
 - c. Erschließung, Abbau, Verarbeitung, Vertrieb oder Weiterverarbeitung von gasförmigen Brennstoffen;
 - d. Stromerzeugung mit einer über das vom Indexanbieter festgelegte Maß hinausgehenden Intensität eines Treibhausgases („THG“).

Weitere Ausschlussrichtlinien:

- (i) Unternehmen, deren Umsatz aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und deren Verkauf an externe Parteien stammt;
- (ii) Unternehmen, deren Umsatz aus unkonventionellem Öl und Gas stammt;
- (iii) Unternehmen mit wesentlichen verlorenen Investitionen;
- (iv) Unternehmen, die einen über den vom Indexanbieter festgelegten Grenzwert hinausgehenden Anteil ihrer Umsätze aus ökologisch schädlichen Tätigkeiten erzielen (wie im Dokument „Index-Methode“ festgelegt);
- (v) Unternehmen, welche die Mindeststandards bezüglich Geschäftspraktiken nicht einhalten, wie vom Indexanbieter festgelegt.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Bestandteilen, die in Einklang mit der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie standen. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,30 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,13 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziele könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die Nachhaltigkeitsziele

Name des Produkts:
L&G Japan ESG Exclusions Paris Aligned UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
2138003AA6WJQFO4X514

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

X Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 5,64 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 2,62 %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Anlageziel des Fonds war die Bereitstellung von Engagement in niedrigen Kohlenstoffemissionen im Large- und Mid-Cap-Aktienmarkt in Japan. Der Fonds versuchte, sein Anlageziel zu erreichen, indem er die Wertentwicklung des Foxberry Sustainability Consensus Japan Total Return Index (der „Index“) nachbildete. Der Index ist so zusammengestellt, dass er die Mindestanforderungen der Verordnung (EU) 2019/2089 hinsichtlich auf das Übereinkommen von Paris abgestimmter EU-Referenzwerte (die „PAB-Verordnung“) erfüllt.

dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Der Index ist ein Referenzwert, der zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds festgelegt wurde.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Die Bewertung der Treibhausgasintensität des Index verglichen mit der Treibhausgasintensität der zugrundeliegenden Universums;	75 %
2. Der Anteil des Index, der in Emittenten engagiert ist, die nicht den Ausschlusskriterien entsprechen, die nachstehend dargelegt werden;	0 % des Index sind in Emittenten investiert, die gemäß den Ausschlusskriterien aus dem Index ausgeschlossen sind.
3. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	31 % *Vergleichsindex: MSCI AC Asia Pacific Excluding Japan Index

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden („Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen““). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?“ sowie gemäß den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. Beispielsweise verwendet der Fonds den Indikator „THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird“, um wichtige nachteilige Auswirkungen in Bezug auf Treibhausgasemissionen zu identifizieren. Zudem zieht der Fonds die durch die Implementierung der Paris-abgestimmten EU-Referenzwerte ermittelten Auswirkungen wie unten beschrieben in Betracht und ergreift entsprechende Maßnahmen. Der Fonds berücksichtigt die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen über die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 1: THG-Emissionen
PAI 2: CO-Fußabdruck
PAI 3: THG-Emissionsintensität der Unternehmen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE NPV	Kommunikation	14,88	Japan
TOYOTA MOTOR CORP NPV	Nichtbasiskonsumgüter	4,01	Japan
SONY GROUP CORP JPY 1.0	Nichtbasiskonsumgüter	3,72	Japan
TOKYO ELECTRON LTD NPV	Technologie	3,24	Japan
KEYENCE CORP	Industriewerte	2,89	Japan
ORIENTAL LAND CO LTD NPV	Nichtbasiskonsumgüter	2,73	Japan
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO NPV	Finanzen	2,66	Japan
DAIICHI SANKYO CO LTD NPV	Basiskonsumgüter	2,20	Japan
SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD NPV	Grundstoffe	2,04	Japan
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR NPV	Finanzen	1,74	Japan
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD NPV	Basiskonsumgüter	1,68	Japan
NINTENDO CO LTD NPV	Nichtbasiskonsumgüter	1,64	Japan
KDDI CORP NPV	Kommunikation	1,59	Japan
RECRUIT HOLDINGS CO LTD JPY 1.0	Basiskonsumgüter	1,49	Japan
SOFTBANK GROUP CORP NPV	Kommunikation	1,47	Japan

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität Die Kriterien für **fossiles Gas** umfassen Emissionsbeschränkungen und einen Wechsel auf vollständig erneuerbare Energie oder kohlenstoffarme Kraftstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltziele leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten,

für die es noch keine CO-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die

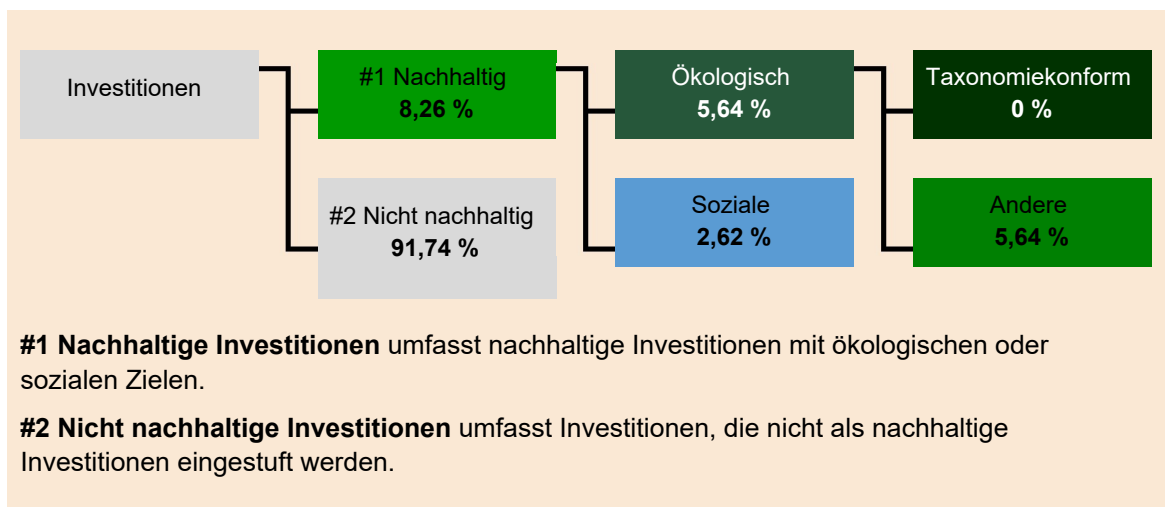
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Im Folgenden wird angegeben, wie hoch der Anteil der Anlagen des Fonds ist, die im Bezugszeitraum als umweltverträgliche und sozial nachhaltige Investitionen gelten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 8,26 % seines Portfolios in Investitionen, die gemäß der Definition des Anlageverwalters als nachhaltige Investitionen (#1) gelten. Der verbleibende Teil der Investitionen fiel unter #2 Nicht nachhaltig, wurde aber dennoch gehalten, um ein nachhaltiges Anlageziel des Fonds (geringe Kohlenstoffemissionen) zu erreichen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Kommunikation	Telekommunikation	29,36
Basiskonsumgüter	Pharmazeutische Produkte	6,86
Finanzen	Banken	6,47
Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	5,45
Industriewerte	Elektronik	4,87
Technologie	Halbleiter	4,62
Nichtbasiskonsumgüter	Automobilhersteller	3,60
Nichtbasiskonsumgüter	Möbel und Innenausstattung	3,41
Finanzen	Versicherung	3,40
Industriewerte	Transport	3,40
Nichtbasiskonsumgüter	Retail	2,73
Andere	Andere	25,83

den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonform Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben**

(CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben**

(OpEx), die die Umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, der Unternehmen, in die investiert wird, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Fonds verpflichtete sich nicht, mehr als 0 % seines Vermögens in mit der EU-Taxonomie konforme Anlagen zu investieren. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

Ja:

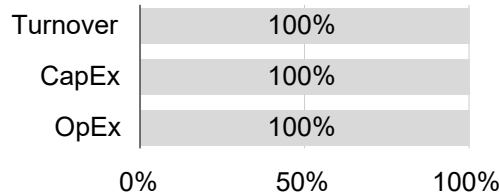
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

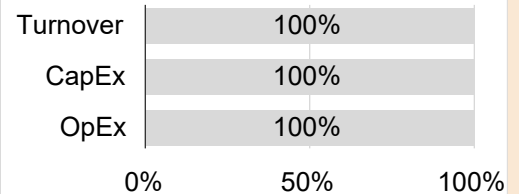
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
■ Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
■ Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt bis zu 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es wird davon ausgegangen, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % beträgt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 5,64 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.

● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 2,62 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den „nicht nachhaltigen“ Anlagen gehörten Aktienwerte, die gehalten wurden, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds zu erreichen. Die ökologischen und sozialen Mindestschutzmaßnahmen, die Teil der im Fonds umgesetzten DNSH-Bewertung sind, beziehen sich auf die vom Index angewendeten Ausschlusskriterien.

Zu den sonstigen Anlagen können Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate gehören. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Fonds setzte die folgende nachhaltigkeitsbezogene Anlagestrategie um, indem er den Index abbildete, der den in der Verordnung (EU) 2020/1818 zur Änderung der Verordnung (EU) 2016/1011 des europäischen Parlaments und des Rates festgelegten Anforderungen an Paris-abgestimmte EU-Referenzwerte hinsichtlich der Mindeststandards für den klimabedingten Wandel entspricht und daher als auf das Übereinkommen von Paris abgestimmter EU-Referenzwert bezeichnet wird. Der Index wurde aus dem zugrundeliegenden Universum aufgebaut, indem bestimmte Ausschlüsse angewendet werden, um die Ausschluss- und Dekarbonisierungskurs gemäß dem Übereinkommen von Paris zu erfüllen oder zu überschreiten, und zwar zusammen mit weiteren Ausschlüssen, wie im Abschnitt „Indexbeschreibung“ des Nachtrags zum Fonds weiter dargelegt.

Ausschlussrichtlinien auf der Grundlage der PAB-Verordnung:

- (i) An Tätigkeiten hinsichtlich umstrittener Waffen beteiligte Unternehmen;
- (ii) Am Anbau und der Produktion von Tabak beteiligte Unternehmen;
- (iii) Unternehmen, welche die Prinzipien des United Nations Global Compact (UNGC) oder der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen verletzen;
- (iv) Unternehmen, die einen über den vom Indexanbieter bestimmten Grenzwert hinausgehenden Anteil ihrer Umsätze aus einer der folgenden Tätigkeiten erzielen:
 - a. Erschließung, Abbau, Verarbeitung, Vertrieb oder Weiterverarbeitung von Steinkohle und Braunkohle;
 - b. Erschließung, Abbau, Verarbeitung, Vertrieb oder Weiterverarbeitung von fossilen Brennstoffen;
 - c. Erschließung, Abbau, Verarbeitung, Vertrieb oder Weiterverarbeitung von gasförmigen Brennstoffen;
 - d. Stromerzeugung mit einer über das vom Indexanbieter festgelegte Maß hinausgehenden Intensität eines Treibhausgases („THG“).

Weitere Ausschlussrichtlinien:

- (i) Unternehmen, deren Umsatz aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und deren Verkauf an externe Parteien stammt;
- (ii) Unternehmen, deren Umsatz aus unkonventionellem Öl und Gas stammt;
- (iii) Unternehmen mit wesentlichen verlorenen Investitionen;
- (iv) Unternehmen, die einen über den vom Indexanbieter festgelegten Grenzwert hinausgehenden Anteil ihrer Umsätze aus ökologisch schädlichen Tätigkeiten erzielen (wie im Dokument „Index-Methode“ festgelegt);
- (v) Unternehmen, welche die Mindeststandards bezüglich Geschäftspraktiken nicht einhalten, wie vom Indexanbieter festgelegt.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Bestandteilen, die in Einklang mit der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie standen. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,30 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,30 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS
ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800V17YF771O2CZ66

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 21,34 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe, und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds unterstützte die oben genannten Merkmale, indem er den ROBO Global® Robotics and Automation UCITS Index (der „Index“) verfolgt, der als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale vorgesehen ist. Obwohl ökologische und soziale Merkmale durch die Anwendung der unten dargelegten nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie beworben werden, sei der Anleger darauf hingewiesen, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Investitionsziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des Index, der in Unternehmen engagiert ist, die nicht den Ausschlusskriterien entsprechen, die nachstehend dargelegt werden	0 % des Index sind in Unternehmen investiert, die gemäß den Ausschlusskriterien aus dem Index ausgeschlossen sind. Der Anteil der Positionen, die aufgrund der Ausschlusskriterien aus dem Index des Fonds ausgeschlossen werden, beträgt 5,1 %.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen einging, wandte der Anlageverwalter eine proprietäre Methode zur Identifizierung nachhaltiger Investitionen geringen Umfangs an, um zu gewährleisten, dass diese nachhaltigen Investitionen keine erheblichen negativen Auswirkungen auf ökologische oder soziale Ziele hatten („DNSH-Bewertung“). Diese Methode prüfte potenzielle nachhaltige Investitionen auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, auf Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und auf bestimmte Bewertungen bezüglich Kontroversen. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 von Anhang I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission genannten Indikatoren herangezogen („SFDR-Maßnahmen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung für nachhaltige Investitionen aus, die im Hinblick auf die oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
INTUITIVE SURGICAL INC USD 0.001	Basiskonsumgüter	1,87	USA
HARMONIC DRIVE SYSTEMS INC NPV	Industriewerte	1,75	Japan
IPG PHOTONICS CORP USD 0.0001	Technologie	1,74	USA
AZENTA INC USD0.01	Basiskonsumgüter	1,71	USA
COGNEX CORP USD 0.002	Industriewerte	1,70	USA
FANUC CORP NPV	Industriewerte	1,69	Japan
KARDEX HOLDING AG CHF 0.45	Industriewerte	1,68	Schweiz
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP USD 0.01	Technologie	1,67	USA
ROCKWELL AUTOMATION INC USD 1.0	Industriewerte	1,66	USA
KEYENCE CORP	Industriewerte	1,62	Japan
SERVICENOW INC USD 0.001	Technologie	1,62	USA
TERADYNE INC USD 0.125	Technologie	1,62	USA
NOVANTA INC NPV	Industriewerte	1,55	Kanada
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP TWD 10.0	Industriewerte	1,54	Kaimaninseln
FUJI CORP/AICHI NPV	Industriewerte	1,54	Japan

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

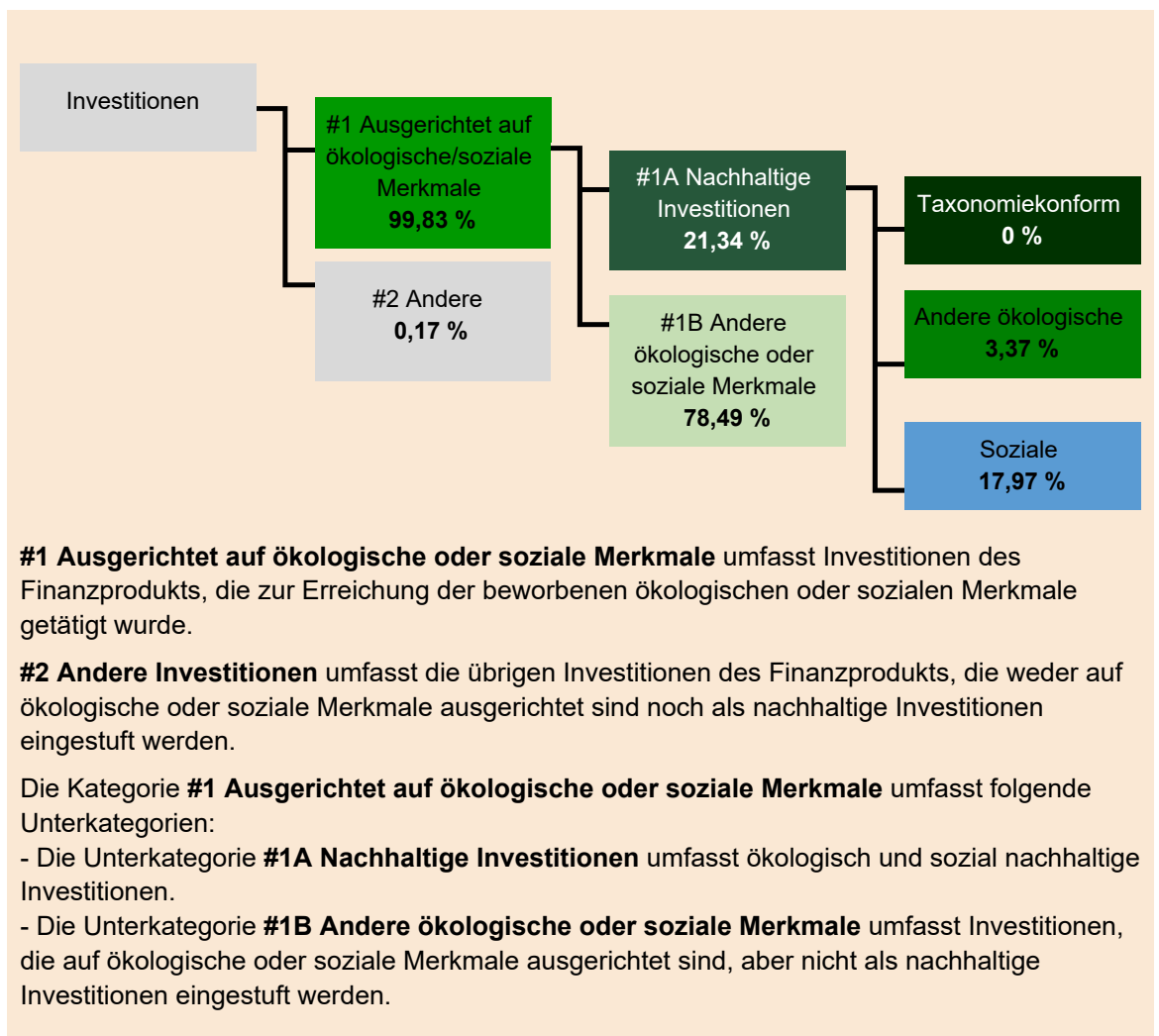
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,83 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 21,34 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums



● ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	33,28
Basiskonsumgüter	Gesundheitsprodukte	10,88
Technologie	Software	10,36
Technologie	Halbleiter	9,18
Industriewerte	Elektronik	8,89
Technologie	Computer	6,45
Industriewerte	Diverse Hersteller	5,52
Industriewerte	Elektroteile und -ausrüstung	3,60
Nichtbasiskonsumgüter	Autoteile und Autozubehör	3,27
Technologie	Büro-/Geschäftsausstattung	1,68
Basiskonsumgüter	Biotechnologie	1,51
Andere	Andere	5,37

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



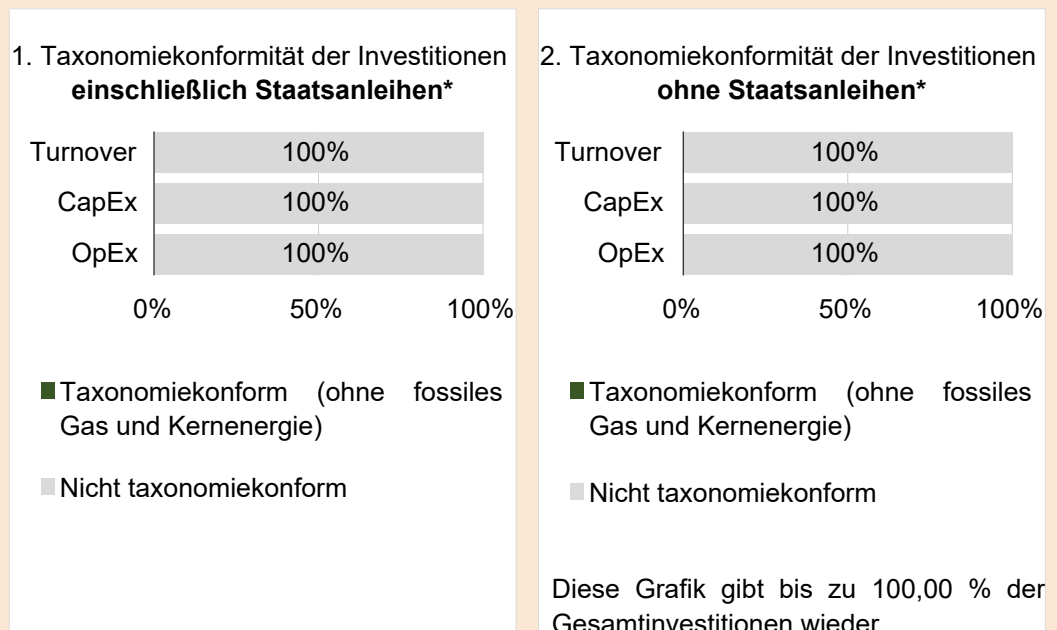
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 3,37 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 17,97 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate können auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wurde.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds bildete den anwendbaren Index nach:

ROBO Global ESG Policy: Der Index schloss Investitionen in Unternehmen aus, die sich nicht an die ROBO Global ESG Policy hielten. Der Indexanbieter schloss nach kritischen Beobachtungen Unternehmen aus, die seiner Meinung nach den Zielen in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung maßgeblich schaden. Jeder Emittent innerhalb des Anlageuniversums des Index wurde nach folgenden Kriterien bewertet: i) die ESG-Risiken, denen die Unternehmen ausgesetzt sind, und die Risiken, dass ihre Aktivitäten zu wesentlichen negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen könnten, ii) die Ausrichtung der Unternehmen an internationalen Normen und Standards, einschließlich der Prinzipien des UN Global Compact, iii) die Beteiligung an schädigenden Tätigkeiten wie Waffen und Rüstung, Tabak, Aktivitäten im Zusammenhang mit Kraftwerkskohle, Tätigkeiten im Zusammenhang mit unkonventionellem und konventionellem Öl und Gas, Energieerzeugung und Tierversuchen, und iv) wirtschaftliche Aktivitäten, die zum Thema beitragen.

Der Index-Anbieter bewertete ESG-Faktoren anhand einer Reihe interner Untersuchungen, regelmäßiger Zusammenarbeit mit den im Index vertretenen Unternehmen sowie der Unterstützung seitens führender ESG-Research-Anbieter, um die Einhaltung aller Vorgaben der ROBO Global ESG Policy zu gewährleisten.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,45 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,09 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-Ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800329VJE5GPXYB89

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

 Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 51,87 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Eigenschaften durch die Nachbildung des Solactive L&G Global Thematic Index (der „Index“), der als Referenzbenchmark für die zur Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale festgelegt ist. Obwohl ökologische und soziale Merkmale durch die Anwendung der unten dargelegten nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie beworben werden, sei der Anleger darauf hingewiesen, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Investitionsziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	„Dieser Fonds hat keinen veröffentlichten Hauptindex, sein breit angelegtes Universum besteht jedoch aus einer Reihe von Unternehmen aus thematisch miteinander zusammenhängenden Bereichen, die von Research-Experten für den jeweiligen Bereich ausgewählt werden. Bei diesem von Solactive verwalteten und berechneten Index betrug der Anteil der aufgrund der ESG-Ausschlusskriterien des Index ausgeschlossenen Beteiligungen 5,69 %. Bei Anwendung der geltenden Ausschlüsse auf das gesamte zulässige Anlageuniversum wären vorbehaltlich Liquiditäts- und Handelsbeschränkungen 11,91 % der Positionen ausgeschlossen worden.“

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
DELTA ELECTRONICS INC TWD 10.0	Industriewerte	0,95	Taiwan
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES I USD 0.0001	Energie	0,94	USA
SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES LT NPV	Nichtbasiskonsumgüter	0,89	Japan
TESLA INC USD 0.001	Nichtbasiskonsumgüter	0,87	USA
PING IDENTITY HLDG CORP USD 0.001	Finanzen	0,85	USA
PILBARA MINERALS LTD NPV	Grundstoffe	0,83	Australien
ALNYLAM PHARMACEUTICALS IN USD 0.01	Basiskonsumgüter	0,82	USA
IONIS PHARMACEUTICALS INC USD 0.001	Basiskonsumgüter	0,82	USA
VERTEX PHARMACEUTICALS INC USD 0.01	Basiskonsumgüter	0,81	USA
MINERAL RESOURCES LTD NPV	Grundstoffe	0,80	Australien
IONQ INC USD 0.0001	Technologie	0,77	USA
RENAULT SA EUR 3.81	Nichtbasiskonsumgüter	0,77	Frankreich
BIOGEN INC	Basiskonsumgüter	0,73	USA
BIOMARIN PHARMACEUTICAL I USD 0.001	Basiskonsumgüter	0,73	USA
ENERSYS USD 0.01	Industriewerte	0,72	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

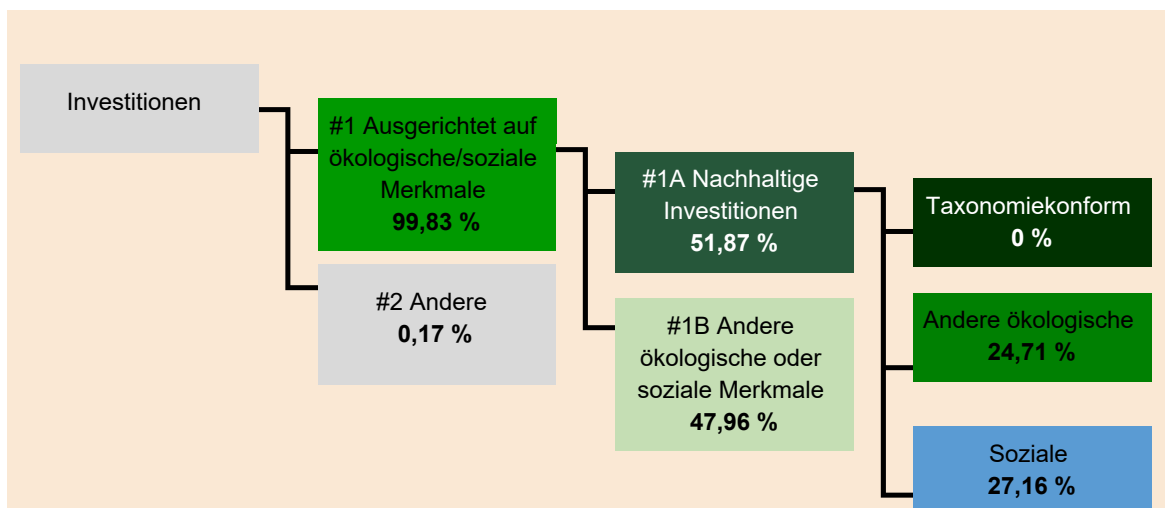
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,83 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 51,85 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurde.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Basiskonsumgüter	Biotechnologie	12,33
Technologie	Software	9,35
Basiskonsumgüter	Gesundheitsprodukte	7,56
Basiskonsumgüter	Pharmazeutische Produkte	6,37
Technologie	Computer	5,82
Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	5,46
Energie	Alternative Energiequellen	5,11
Nichtbasiskonsumgüter	Automobilhersteller	4,85
Kommunikation	Internet	4,71
Industriewerte	Transport	4,48
Technologie	Halbleiter	3,90
Andere	Andere	30,06

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



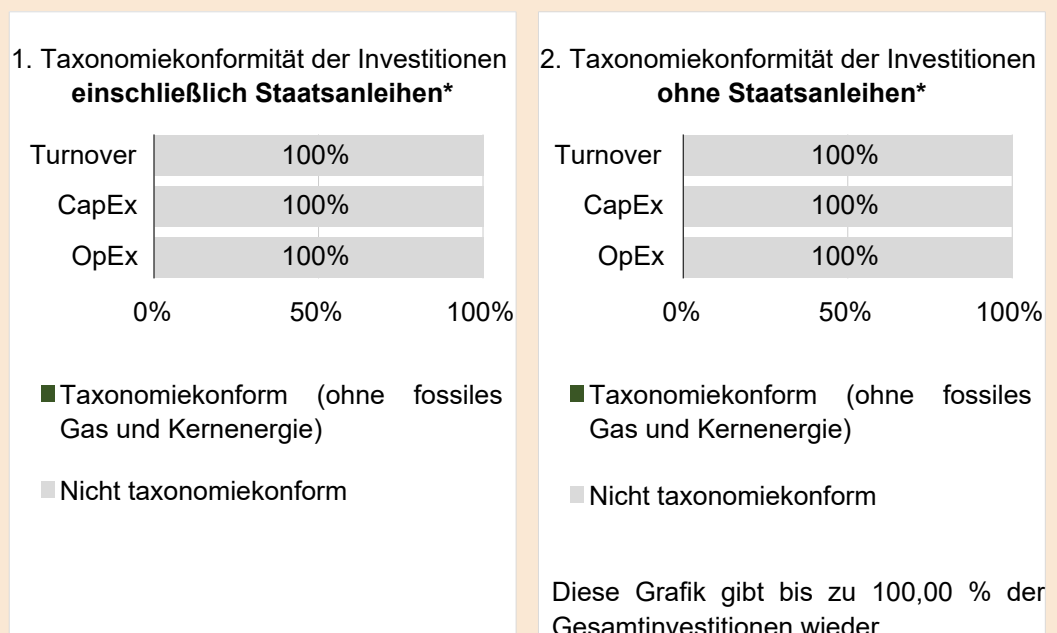
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 24,71 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 27,16 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds bildet den anwendbaren Index nach:

ESG-erweiterte Ausschlüsse: Der Index schließt Unternehmen aus, die (i) den UN Global Compact nicht einhalten, (ii) im Zusammenhang mit einer umstrittenen Angelegenheit stehen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt sind, die schwerwiegende Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft haben und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellen), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit verbundenen Produkt/Dienstleistung, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen, (vi) am Einzelhandel oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nichtangriffswaffen) und an Kunden aus dem militärischen Bereich bzw. der Strafverfolgung sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen, (vii) an der Gewinnung und Verstromung von Kraftwerkskohle beteiligt sind oder die Stromerzeugungskapazität von Kohle erhöhen, (viii) an der Gewinnung, Produktion oder Kapazitätserhöhung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen, (ix) an der Gewinnung von Ölsand, der Exploration/Extraktion von arktischem Erdöl und Erdgas, der Gewinnung von Schiefergas oder der Kapazitätserhöhung von unkonventionellem Erdöl und Erdgas, (x) an der Produktion, dem Vertrieb, den unterstützenden Produkten oder der Kapazitätserweiterung von Kernenergie, (xi) an der Produktion, dem Einzelhandel oder den damit verbundenen Dienstleistungen/Produkten von Alkohol, (xii) am Betrieb, der Spezialausrüstung oder den unterstützenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen und (xiii) an der Produktion oder dem Vertrieb von Unterhaltung für Erwachsene beteiligt sind.

Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Beteiligung“ wurden vom Indexanbieter festgelegt und auf der Website der Solactive AG <https://www.solactive.com/indices/?index=DE000SL0F799> näher erläutert.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds finden Sie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds in der Beschreibung der Anlagestrategie.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,35 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,18 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.

Vorlage —Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:
L&G Cyber Security UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800ZSPQ9TKEKVEN40

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 8,61 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe, und
- Förderung erneuerbarer Energien.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Eigenschaften durch die Nachbildung des ISE Cyber Security® UCITS Index Net Total Return (der „Index“), der als Referenzbenchmark für die zur Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale diene. Obwohl durch die Anwendung der nachfolgend beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ökologische und soziale Merkmale beworben wurden, ist zu beachten, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Anlageziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des Index, der in Unternehmen engagiert ist, die nicht den Ausschlusskriterien entsprechen, die nachstehend dargelegt werden	0 %
2. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	13 % Der Anteil der Positionen, die aufgrund der Ausschlusskriterien aus dem breiteren Anlageuniversum ausgeschlossen werden 21,9 % Der Anteil der Positionen, die aufgrund der Ausschlusskriterien aus dem Index des Fonds ausgeschlossen werden

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen einging, wandte der Anlageverwalter eine proprietäre Methode zur Identifizierung nachhaltiger Investitionen geringen Umfangs an, um zu gewährleisten, dass diese nachhaltigen Investitionen keine erheblichen negativen Auswirkungen auf ökologische oder soziale Ziele hatten („DNSH-Bewertung“). Diese Methode prüfte potenzielle nachhaltige Investitionen auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, auf Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und auf bestimmte Bewertungen bezüglich Kontroversen. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 von Anhang I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission genannten Indikatoren herangezogen („SFDR-Maßnahmen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung für nachhaltige Investitionen aus, die im Hinblick auf die oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wie oben beschrieben, wurden die in Tabelle 1 von Anhang I der SFDR aufgeführten Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen in die Methodik für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Anlagen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 11: Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
PING IDENTITY HLDG CORP USD 0.001	Finanzen	5,65	USA
PALO ALTO NETWORKS INC USD 0.0001	Kommunikation	4,52	USA
CLOUDFLARE INC - CLASS A USD0.001	Technologie	4,46	USA
FORTINET I USD 0.001	Technologie	4,34	USA
CISCO SYS INC USD 0.001	Kommunikation	4,23	USA
SPLUNK INC USD 0.001	Technologie	4,23	USA
CYBERARK SOFTWARE LTD ILS 0.01	Technologie	4,21	Israel
JUNIPER NETWORKS INC USD 0.00001	Kommunikation	4,15	USA
BLACKBERRY LTD NPV	Technologie	4,13	Kanada
CHECK POINT SOFTWARE TECH USD0.01	Technologie	4,06	USA
DARKTRACE PLC 1P	Technologie	4,06	Vereinigtes Königreich
QUALYS INC USD 0.001	Technologie	4,03	USA
AKAMAI TECHNOLOGIES INC USD 0.01	Technologie	4,02	USA
TREND MICRO INC NPV	Kommunikation	3,99	Japan
ZIFF DAVIS INC USD 0.01	Kommunikation	3,98	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

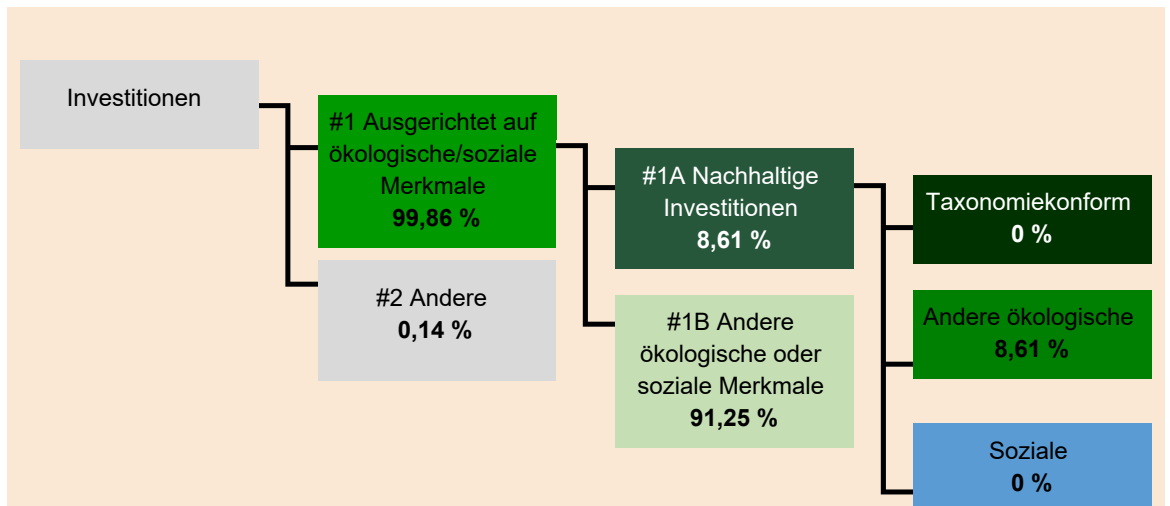
Im Folgenden ist angegeben, welcher Anteil des Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale bewarb und welcher Anteil auf nachhaltige Investitionen entfiel.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,86 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 8,61 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurde.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● ***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Technologie	Computer	37,13
Technologie	Software	31,46
Kommunikation	Internet	19,93
Kommunikation	Telekommunikation	9,14
Finanzen	Versicherung	1,39
Basiskonsumgüter	Gewerbliche Dienstleistungen	0,85
Industriewerte	Elektronik	0,09

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



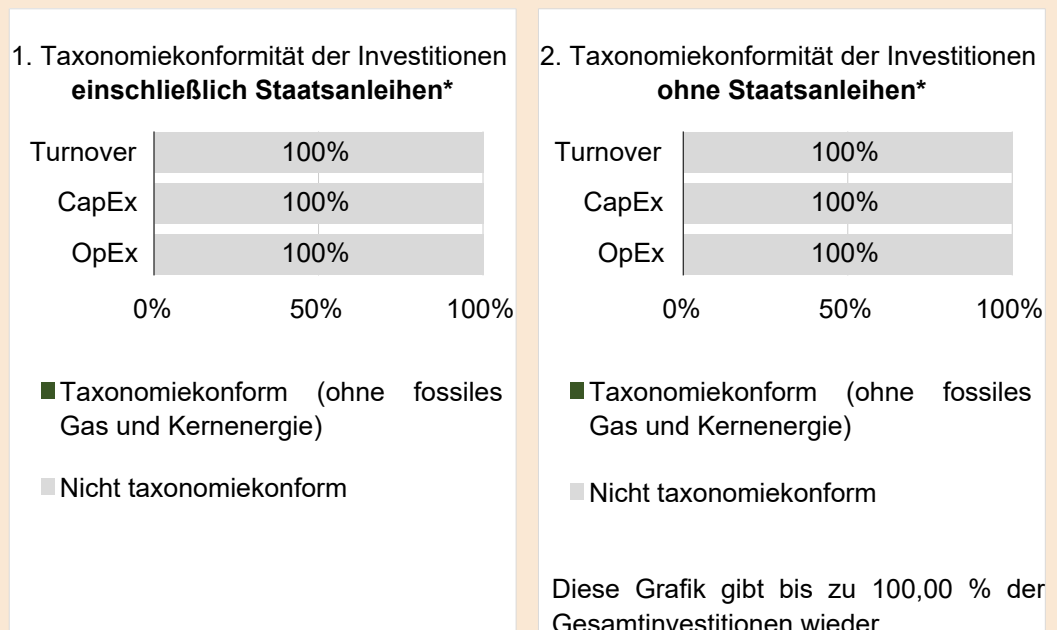
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert⁽¹⁾?

- Ja:
- In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

1 Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 8,61 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds ging keine Verpflichtung ein, einen Mindestanteil an sozial nachhaltigen Anlagen zu tätigen.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate können auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht wurde.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds bildete den Index ab, der Unternehmen ausschloss, die:

- vom Datenlieferanten als in schwerwiegende Kontroversen verwickelt eingestuft wurden (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt waren, die schwerwiegende Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft hatten und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellen),
- die UNGC-Grundsätze nicht einhalten, und/oder
- einen bestimmten Anteil ihrer Einnahmen aus den schädlichen Branchen Tabak, nicht erneuerbare Energien und Waffen generieren, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt.

Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Beteiligung“ wurden unter Bezugnahme auf die von der Nasdaq, Inc. veröffentlichte Indexmethodik festgelegt.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,45 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,05 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-Ante Tracking Error.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.