

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF

Klasse SINGLECLASS • ISIN IE000YZIVX22 • Ein Teilfonds des Franklin Templeton ICAV

Die Verwaltungsgesellschaft ist Franklin Templeton International Services S.à r.l.

Ziele und Anlagepolitik

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF (der „Fonds“) bietet ein Engagement in auf Euro und US-Dollar lautenden Staatsanleihen, die von Schwellenländern begeben werden.

Der Fonds sieht eine möglichst genaue Nachbildung der Wertentwicklung des ICE Catholic Principles ESG Emerging Markets External Sovereign Index (der „Index“) vor, unabhängig davon, ob das Indexniveau steigt oder fällt. Gleichzeitig versucht er, den Tracking Error zwischen der Wertentwicklung des Teilfonds und der des Index zu minimieren.

Der Index basiert auf dem ICE BofA Diversified Emerging Markets External Debt Sovereign Bond Index (der „übergeordnete Index“) und setzt sich aus auf US-Dollar und Euro lautenden Staatsanleihen von Schwellenländern zusammen.

Indexwertpapiere können mit beliebiger Laufzeit begeben werden, sofern zum Zeitpunkt ihrer Emission noch mindestens 18 Monate bis zu ihrer endgültigen Fälligkeit verbleiben und die Restlaufzeit bis zur endgültigen Fälligkeit an jedem Indexanpassungstag mindestens ein Jahr beträgt. Sie können sowohl fest als auch variabel verzinst werden und ein Rating von „Investment Grade“ oder darunter aufweisen. Allerdings ist ein Mindestrating von B3 erforderlich, das auf der Grundlage der durchschnittlichen Ratings anerkannter Rating-Agenturen ermittelt wird. Indexwertpapiere werden von staatlichen Emittenten begeben, bei denen es sich um Regierungsbehörden und quasi-staatliche Stellen handeln kann. Um seine Liquidität und Investierbarkeit zu erhöhen, schließt der Index zudem Anleihen aus dem übergeordneten Index aus, deren ausstehendes Volumen sich auf weniger als 500 Millionen US-Dollar oder Euro (je nach Nennwährung) beläuft.

Der Index (i) schließt Wertpapiere aus dem übergeordneten Index aus, die von Ländern begeben werden, welche bestimmte vom Indexanbieter festgelegte römisch-katholische Grundsätze nicht erfüllen, und (ii) passt die Gewichtung der Wertpapiere im Vergleich zum übergeordneten Index an, um die gesamte CO₂-Bilanz des Index im Vergleich zum übergeordneten Index zu verbessern, jeweils wie unten beschrieben.

Der Index beginnt mit dem Anlageuniversum des übergeordneten Index und schließt die Anleihen von Ländern aus, die bei den folgenden Kriterien, die vom Indexanbieter als römisch-katholische Grundsätze identifiziert wurden, schlecht abschneiden: moralische Integrität der Regierungen, soziale Gerechtigkeit, Abschaffung der Todesstrafe und Verantwortung für den Planeten auf der Grundlage von Umwelt-, Sozial- und Governance-Bewertungsdaten (ESG).

Die angewandten Anlagekriterien führen dazu, dass der Index gegenüber seinem übergeordneten Index insgesamt eine um 30 % bessere CO₂-Bilanz

aufweist. Die länderspezifischen Engagements im Index sind jeweils auf 10 % begrenzt.

Die Indexbestandteile werden basierend auf ihrem aktuellen ausstehenden Volumen kapitalisierungsgewichtet, sofern die Gesamtallokation in einem einzelnen Land 10 % nicht übersteigt.

Weitere Informationen zum Index, unter anderem über seine Regeln und Wertentwicklung, sind unter <https://indices.theice.com/> erhältlich. Hierfür muss im Feld „Index“ des Bereichs „Index Snapshot“ die entsprechende Indexkennung (EMCV) eingegeben werden. Die Indexkomponenten können durch Eingabe der Indexkennung auf der Registerkarte „ETF Benchmarks“ unter <https://indices.theice.com/publications#> abgerufen werden.

Der Fonds darf Derivate nur zur effizienten Portfolioverwaltung verwenden.

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

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

Die Anteile des Fonds sind an mindestens einer Börse notiert und werden dort gehandelt. Unter gewöhnlichen Umständen können nur autorisierte Teilnehmer (z. B. ausgewählte Finanzinstitute) Anteile direkt mit dem Fonds handeln. Andere Anleger können über einen Broker an einer oder mehreren Börsen, an der bzw. an denen die Anteile gehandelt werden, täglich mit Anteilen handeln.

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

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

Begriffserklärungen

Schuldtitle: Wertpapiere, die die Verpflichtung eines Emittenten darstellen, einen Kredit zu einem bestimmten Termin zurückzuzahlen und Zinsen zu zahlen.

Derivate: Finanzinstrumente, deren Beschaffenheit und Wert auf der Wertentwicklung eines oder mehrerer Basiswerte – typischerweise Wertpapiere, Indizes, Währungen oder Zinssätze – beruhen.

Risiko- und Ertragsprofil



← Geringeres Risiko / Potenziell geringere Erträge | 4 | Höheres Risiko / Potenziell höhere Erträge →

Was bedeutet diese Kennzahl und was sind ihre Grenzen?

Diese Kennzahl zeigt Ihnen die Kursbewegungen der entsprechenden Anteilsklasse auf der Grundlage historischer Daten.

Es handelt sich hierbei um keinen zuverlässigen Hinweis auf das zukünftige Risikoprofil des Fonds. Es kann nicht garantiert werden, dass die angezeigte Kategorie fortan unverändert bleibt. Sie kann sich im Laufe der Zeit ändern.

Die niedrigste Kategorie ist nicht gleichbedeutend mit völliger Risikofreiheit.

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

Warum ist der Fonds dieser spezifischen Kategorie zugeordnet?

Der Fonds beabsichtigt, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Dieser besteht aus Schuldtiteln in Schwellenländern, die aus dem Hauptindex ausgewählt werden. Derartige Vermögenswerte unterliegen erfahrungsgemäß Kursbewegungen aufgrund von Faktoren wie der allgemeinen Marktvolatilität, Änderungen der finanziellen Aussichten oder

Devisenmarktschwankungen. Aufgrund dessen kann die Wertentwicklung des Fonds im Laufe der Zeit schwanken.

Risiken von erheblicher Relevanz, die von der Kennzahl nicht angemessen erfasst werden:

Kontrahentenrisiko: das Risiko, dass Finanzinstitute oder Agenten (die als Kontrahenten von Finanzkontrakten agieren) ihren Verpflichtungen aufgrund von Insolvenz, Konkurs oder aus anderen Gründen nicht nachkommen.

Kreditrisiko: das Risiko aus einem Ausfall, bei dem ein Emittent fällige Kapital- oder Zinszahlungen nicht leistet, ergebende Verlustrisiko. Dieses Risiko ist höher, wenn der Fonds niedrig eingestufte Sub-Investment-Grade-Wertpapiere hält.

Mit Derivaten verbundenes Risiko: Das Risiko des Verlusts in Bezug auf ein Finanzinstrument, wenn eine geringfügige Veränderung des Werts einer Basisanlage einen größeren Einfluss auf den Wert des betreffenden Finanzinstruments haben kann. Derivate können zusätzlichen Liquiditäts-, Kredit- und Kontrahentenrisiken unterliegen.

Schwellenmarktrisiko: Das Risiko in Verbindung mit der Anlage in Ländern, deren politische, wirtschaftliche, rechtliche und aufsichtsrechtliche Systeme weniger ausgereift sind. In diesen Ländern kann es zu politischen und wirtschaftlichen Turbulenzen, fehlender Liquidität oder Transparenz sowie Problemen bei der Wertpapierverwahrung kommen.

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

Indexbezogenes Risiko: Das Risiko, dass quantitative Techniken, die zur

Zusammenstellung des Index verwendet werden, den der Fonds nachbilden soll, nicht das beabsichtigte Ergebnis erzielen, oder dass das Portfolio des Fonds von der Zusammensetzung oder Wertentwicklung seines Index abweicht.

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

Mit staatlichen Schuldtiteln verbundenes Risiko: Das Risiko, dass der Wert von Wertpapieren, die von Regierungen oder Behörden begeben werden, von der Kreditwürdigkeit der betreffenden Regierung beeinträchtigt werden kann, einschließlich des Risikos eines Zahlungsausfalls oder möglichen Zahlungsausfalls der betreffenden Regierung.

Umfassende Informationen über alle für den vorliegenden Fonds geltenden Risiken finden Sie im Abschnitt „Risikoabwägungen“ des aktuellen Verkaufsprospekts von Franklin Templeton ICAV.

Kosten

Die von Ihnen getragenen Kosten werden für die laufende Verwaltung des Fonds verwendet, einschließlich für Vermarktung und Vertrieb der Fondsanteile. Diese Kosten verringern das potenzielle Wachstum Ihrer Anlage.

Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

Ausgabeaufschläge	Nicht zutreffend*
Rücknahmeabschläge	Nicht zutreffend*

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

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

Laufende Kosten	0.35%
------------------------	-------

Kosten, die unter bestimmten Umständen vom Fonds abgezogen werden.

Erfolgsgebühren	Nicht zutreffend
------------------------	------------------

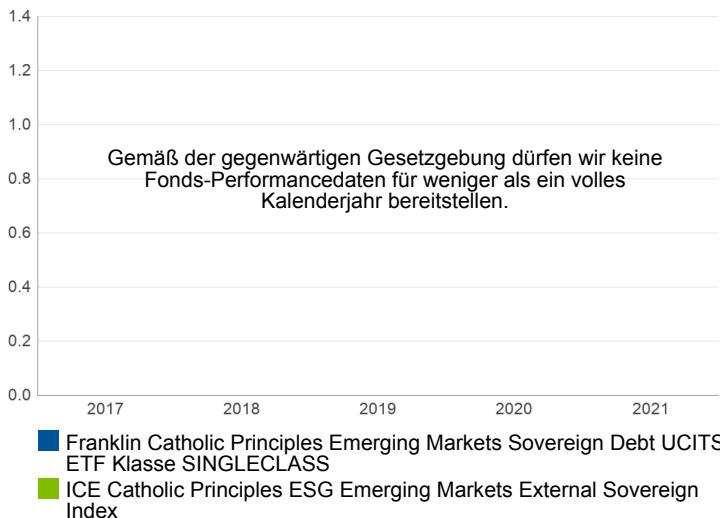
* Es werden keine Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge erhoben, wenn Anleger am Sekundärmarkt mit Anteilen handeln – d. h., wenn Anteile an einer Börse ge- und verkauft werden. In solchen Fällen zahlen die Anleger eventuell von ihrem Broker erhobene Gebühren. Autorisierte Teilnehmer, die direkt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

Die angegebenen Ausgabeaufschläge und Rücknahmeabschläge sind Höchstwerte. In manchen Fällen zahlen Sie eventuell weniger. Weitere Informationen dazu erhalten Sie von Ihrem Finanzberater.

Bei den an dieser Stelle ausgewiesenen laufenden Kosten handelt es sich um eine Kostenschätzung. Wir haben geschätzte Zahlen verwendet, da wir gemäß den derzeit anwendbaren Bestimmungen keine laufenden Kosten für Anteilsklassen berechnen dürfen, bei denen Daten für weniger als 12 Monate vorliegen. Der Jahresbericht von Franklin Templeton ICAV für jedes Geschäftsjahr enthält Einzelheiten zu den genauen berechneten Kosten.

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

Wertentwicklung in der Vergangenheit



- Der Fonds wurde im Jahr 2022 aufgelegt.

Praktische Informationen

- Die Verwahrstelle von Franklin Templeton ICAV ist State Street Custodial Services (Ireland) Limited.
- Weitere Informationen über den Fonds, Exemplare seines Verkaufsprospekts und Nachtrags und seine aktuellsten Jahres- und Halbjahresberichte erhalten Sie auf der Website www.franklintempleton.com oder kostenlos von der Verwaltungsstelle, State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland, oder von Ihrem Finanzberater. Diese Dokumente sind jeweils in englischer und gewissen anderen Sprachen erhältlich.
- Der aktuelle Nettoinventarwert und sonstige praktische Informationen zum Fonds sind bei der Verwaltungsstelle, State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland oder auf www.franklintempleton.com erhältlich.
- Der indikative Nettoinventarwert wird auf den Terminals der bedeutendsten Marktdatenanbieter angezeigt.
- Bitte beachten Sie, dass die irischen Steuergesetze Auswirkungen auf Ihre persönliche Steuersituation haben können. Bitte sprechen Sie mit Ihrem

Finanz- oder Steuerberater, bevor Sie sich zu einer Anlage entschließen.

- Franklin Templeton International Services S.à r.l. kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Verkaufsprospekts des Fonds vereinbar ist.
- Der vorliegende Fonds ist ein Teilfonds von Franklin Templeton ICAV. Der Verkaufsprospekt und die Jahres- und Halbjahresberichte beziehen sich auf alle Teilfonds von Franklin Templeton ICAV. Bei allen Fonds von Franklin Templeton ICAV sind Vermögenswerte und Verbindlichkeiten getrennt. Aufgrund dessen werden alle Fonds separat geführt.
- Sie können keine Anteile gegen Anteile anderer Teilfonds von Franklin Templeton ICAV umtauschen.
- Die Einzelheiten der aktuellen Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft (einschließlich einer Beschreibung dessen, wie Vergütungen und Vergünstigungen berechnet werden, und der Identität der für die Zuteilung der Vergütungen und Vergünstigungen verantwortlichen Personen sowie die Zusammensetzung des Vergütungsausschusses) sind auf www.franklintempleton.lu verfügbar. Ein Druckexemplar ist kostenlos erhältlich.

Dieser Fonds ist in Irland zugelassen und wird von der Central Bank of Ireland reguliert. Franklin Templeton International Services S.à r.l. ist im Großherzogtum Luxemburg zugelassen und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier reguliert. Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 01/12/2022.