

Informationen nach Verordnung (EU) 2019/2088 vom 27.11.2019 (Transparenzverordnung)

(ESGIE00BMDPBY65)

Sehr geehrte Kundin, sehr geehrter Kunde,

die Transparenz-Verordnung verpflichtet uns, Sie über bestimmte Aspekte der Nachhaltigkeit in der von Ihnen gewählten Kapitalanlage zu informieren, wenn damit

- eine nachhaltige Investition angestrebt wird oder
- unter anderem ökologische oder soziale Merkmale oder eine Kombination aus diesen Merkmalen beworben wird.

Nachfolgend geben wir Ihnen die Informationen der Kapitalverwaltungsgesellschaft zu dem von Ihnen gewählten Fonds weiter. Zusätzliche Informationen zu diesem Fonds können Sie der Internetseite der Kapitalverwaltungsgesellschaft entnehmen.

Fondsname: Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF
ISIN: IE00BMDPBY65

Kapitalverwaltungsgesellschaft: Franklin Libertyshares ICAV
Internetseite: www.franklintempleton.de

Nachhaltiges Anlageziel (Artikel 9)

Der Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF wurde entwickelt, um das Wertentwicklungs- und Anlageziel des zugrunde liegenden Index nachzubilden, der so gewichtet wurde, dass er insgesamt mit dem Szenario einer Klimaerwärmung um 1,5°C vereinbar ist. Der Index ist so aufgebaut, dass er die auf die Verordnung hinsichtlich auf das Übereinkommen von Paris abgestimmte EU-Referenzwerte (EU PAB) befolgt und zielt auf das Erreichen einer Dekarbonisierung von 7% im Vergleich zum Vorjahr ab. Gleichzeitig peilt er dabei eine Senkung der Treibhausgasintensität um mindestens 50% im Vergleich zu seinem zugrunde liegenden Referenzindex an. Er verlässt sich auf die Methodik des Index, um sicherzustellen, dass keine seiner Positionen dem Grundsatz „Do No Significant Harm“ zuwiderläuft, also kein anderes Umweltziel verletzt.

Anlagestrategie

Der Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF bildet den STOXX Europe 600 Paris Aligned Index (der „Index“) nach, der entwickelt wurde, um die Wertentwicklung zulässiger Wertpapiere aus dem STOXX Europe 600 Index zu messen, die so ausgewählt und gewichtet werden, dass sie mit dem Szenario einer Erderwärmung um 1,5°C vereinbar sind. Er bietet ein Engagement in europäischen Wertpapieren mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung, die aus dem STOXX Europe 600 Index (der „übergeordnete Index“) ausgewählt wurden, und er zielt darauf ab, Anlegern zu helfen, sich auf eine kohlenstoffarme Wirtschaft zuzubewegen, indem er Anlagen an das Pariser Klimaabkommen anpasst.

Methodik

Der STOXX Europe 600 Paris Aligned Index ist ein systematischer, regelbasierter Index, der STOXX gehört und von STOXX berechnet wird. Ziel des Index ist es, die Empfehlungen der Technischen Expertengruppe (TEG) der Europäischen Kommission in seiner im Abschlussbericht zu den Klima-Referenzwerten und ESG-Offenlegungen der Referenzwerte veröffentlichten Form zu befolgen. Im Bericht wird die Definition von Mindeststandards für die Methodik von auf ‚Klimabedingten Wandel‘ und ‚Paris-abgestimmte‘ EU-Referenzwert-Indizes, die an den Zielen des Pariser Abkommens ausgerichtet wären, vorgeschlagen und das Risiko des Greenwashing behandelt.

Der Index umfasst auch Faktoren, die darauf abzielen, die Risiken des Wandels und die Chancen des Klimawandels so zu handhaben, dass diese an den Empfehlungen der Task Force zur Offenlegung klimabezogener Finanzinformationen (TCFD) des Financial Stability Board im Abschlussbericht 2017, in dem das Risiko des Wandels und Chancen des Klimawandels behandelt werden, ausgerichtet werden.

Im Vergleich zum übergeordneten Index (i) nimmt der Index eine Übergewichtung derjenigen Unternehmen vor, die sich zur Reduzierung von Treibhausgasemissionen verpflichtet haben, und deren Treibhausgasintensität anhand der in den PAB-Verordnungen beschriebenen Scope-1-, Scope-2- und Scope-3-Emissionen erfasst wird, und (ii) weist der Index eine Dekarbonisierung von 50% auf. Darüber hinaus muss sich die Treibhausgasintensität des Index insgesamt um 7% pro Jahr verringern. Die Auswahl und Gewichtung von Indexwertpapieren beruhen

auf der Einschätzung des Indexanbieters darüber, wie die einzelnen Unternehmen innerhalb des übergeordneten Index auf das Szenario einer globalen Erderwärmung von 1,5°C ausgerichtet sind. Hierfür werden beispielsweise die Emissionen eines Unternehmens, sein „grüner“ Umsatz, Umweltwertungen, wissenschaftlich fundierte Klimaziele und ergriffene Maßnahmen und Strategien zur Reduzierung von Emissionen berücksichtigt. Unternehmen, die nicht oder schlecht auf dieses Szenario ausgerichtet sind, erhalten eine geringere Gewichtung als diejenigen, die sich besser darauf ausgerichtet haben.

Die Gewichtung von Industriesektoren mit hohem Einfluss auf den Klimawandel (z.B. NACE2-Branchenkategorien wie Strom-, Gas-, Dampf- und Klimalanlagenversorgung, Transport und Lagerung sowie Fertigung) im Index entspricht mindestens den Gewichtungen dieser Sektoren im übergeordneten Index. Wertpapiere von Unternehmen, die Umsatz mit der Exploration oder Verarbeitung von Kohle, Öl und Gas oberhalb der in den PAB-Verordnungen festgelegten Schwellenwerte erzielen, sind jedoch ausgeschlossen. Gleiches gilt für Wertpapiere von Unternehmen, die mehr als 10% ihres Umsatzes mit thermischer kohlebasierter Stromerzeugung oder mehr als 50% durch Stromerzeugung mit einer Kohlenstoffintensität der Lebenszyklusemissionen von mehr als 100g CO₂e je kWh erzielen. Darüber hinaus sind Unternehmen, die im übergeordneten Index enthalten sind, jedoch nicht die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen – eines globalen Pakts, um Unternehmen weltweit zu einer nachhaltigen und sozial verantwortlichen Politik zu ermutigen – berücksichtigen oder an Tabakerzeugnissen oder umstrittenen Waffen wie etwa Landminen und Streumunition beteiligt sind, aus dem Index ausgeschlossen.

Datenquelle(n) und -verarbeitung (Nachhaltigkeitsindikatoren)

Der Index umfasst eine Vielzahl spezifischer Dekarbonisierungsziele und richtet sich durch Verwendung von Optimierungen mit mehreren Modellbedingungen an bestimmten spezifischen Kriterien aus. Dazu zählen:

- Ausrichtung an einem Klimaszenario mit einer Erwärmung um 1,5 °C anhand von Daten von ISS Analytics
- Geringere Treibhausgasemissionsintensität insgesamt (THG in CO₂-Äquivalenten ausgedrückt), im Vergleich zum jeweiligen zugrunde liegenden übergeordneten Index um mindestens 50% gesenkt.
- Ein Mindestsatz für Selbst-Dekarbonisierung bei der THG-Emissionsintensität in Einklang mit der vom Zwischenstaatlichen Ausschuss für Klimaänderungen (IPCC) implizierten Marschroute, dem sehr ehrgeizigen 1,5°C-Szenario, das einer Verringerung der durchschnittlichen THG-Intensitätssenkung von mindestens 7% pro Jahr entspricht.
- Ein zunehmendes Engagement in Unternehmen mit wissenschaftsbasierten Zielen aus der Science Based Target Initiative (SBTI), die glaubwürdig sind und im Einklang mit der oben erwähnten Dekarbonisierung stehen.
- Ein Engagement in Sektoren mit weitreichenden Folgen für den Klimawandel, das mindestens dem des übergeordneten Index entspricht.
- Verwaltetes Engagement in potenziellen Chancen des Klimawandels anhand kontrollierten Teilens des Grün-zu-Braun-Umsatzes, um sich an den Empfehlungen der Expertenkommission TCFD auszurichten.
- Gedeckeltes Engagement in nicht offenlegenden Kohlenstoffunternehmen.
- Deckelung der Gewichtung auf Einzelwertebene zur Handhabung von Liquidität und Diversifizierung.

Erreichen des Anlageziels Nachhaltigkeit

Der Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF ist am STOXX Europe 600 Paris Aligned Index ausgerichtet und bildet dessen Wertentwicklung nach. Der Index wurde in Anlehnung an die Verordnungen hinsichtlich auf das Übereinkommen von Paris abgestimmte EU-Referenzwerte (EU PAB) (Verordnung (EU) 2019/2089) (die „PAB“-Verordnungen) erstellt.

Der ESG Climate Impact Assessment-Bericht von ISS, der vierteljährlich vom Indexanbieter (STOXX®) herausgegeben wird, liefert detaillierte Kohlenstoff- und klimabedingte Messgrößen durch den Vergleich des STOXX® Europe 600 PAB Index mit dem STOXX® Europe 600 Index. Zu den wichtigsten Messgrößen zählen: Analyse der Emissionsbelastung, Analyse des Emissionsanteils, Treibhausgasemissionsintensität, Analyse des Klimaszenarios und Risikoanalyse des klimabedingten Wandels.