

# Legal & General UCITS ETF Plc

Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss für das  
Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

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



# 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	17
Bericht des Prüfungsausschusses	49
Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber vom 30. Juni 2022	53
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	54

## Jahresabschluss der Gesellschaft

Bilanz der Gesamtgesellschaft	62
Gesamtergebnisrechnung der Gesamtgesellschaft	63
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens der Gesamtgesellschaft	64
Kapitalflussrechnung der Gesamtgesellschaft	65

## Jahresabschlüsse der Fonds

Bilanz	
zum 30. Juni 2022	66
Vergleichsdaten zum 30. Juni 2021	73
Gesamtergebnisrechnung	
für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	79
Vergleichsdaten für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	86
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	
für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	92
Vergleichsdaten für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	96
Anmerkungen zum Halbjahresabschluss	99

## Sonstige Informationen – ungeprüft

Aufstellung der Vermögenswerte	227
OGAW-V-Vergütungspolitik	660
Value-at-Risk-Bericht („VaR“-Bericht)	661
Weitere Informationen	662
Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	664
Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor	672
Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe	725

## Verwaltungsrat und sonstige Informationen

### Verwaltungsrat:

Feargal Dempsey (Ire) <sup>(1) (2)</sup>  
 David Fagan (IRE) <sup>(1)</sup>  
 Howie Li (Brite)  
 Patrizia Libotte (Irin)  
 Donard McClean (IRE) <sup>(1)</sup>

Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführend

<sup>(1)</sup> Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

<sup>(2)</sup> Vorsitzender

### Verwaltungsgesellschaft:

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

### Anlageverwalter:

GO ETF Solutions LLP (bis 1. November 2021)\*  
 One Coleman Street  
 London, EC2R 5AA  
 Vereinigtes Königreich

\*Nur Aktien- und synthetische Fonds

Legal & General Investment Management Limited  
 (seit dem 1. November 2021)  
 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, Transferstelle 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

**Sicherheitenverwalter:**

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

**Vertriebsstelle:**

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

**Lokale Zahlstelle und Vertretung in der Schweiz:**

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

Registernummer: 459936

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 aufgebracht 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 2022 waren die folgenden 55 Fonds (30. Juni 2021: 55 Fonds) der Gesellschaft von der Zentralbank genehmigt, von denen 43 (30. Juni 2021: 41 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 E Fund MSCI China A UCITS ETF	Fonds mit physischer Nachbildung	MSCI China A Onshore Index	E Fund Management (Hong Kong) Co., Limited
L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF	"	Russell 2000® Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Gold Mining UCITS ETF	"	DAXglobal® Gold Miners Index	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
L&G US Equity UCITS ETF	"	Solactive Core United States Large & Mid Cap Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G UK Equity UCITS ETF	"	Solactive Core United Kingdom Large & Mid Cap Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Japan Equity UCITS ETF	"	Solactive Core Japan Large & Mid Cap USD Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Global Equity UCITS ETF	"	Solactive Core Developed Markets Large & Mid Cap USD Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	"	Solactive Core Developed Markets Europe ex UK Large & Mid Cap EUR Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	"	Solactive Core Developed Markets Pacific ex Japan Large & Mid Cap USD Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Emerging Markets Equity UCITS ETF <sup>1</sup>	"	Solactive Core Emerging Markets Large & Mid Cap USD Index NTR	Legal & General Investment Management Limited

<sup>1</sup> 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 Germany Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	"	Solactive Core Germany Large & Mid Cap Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Italy Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	"	Solactive Core Italy Large & Mid Cap Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
L&G Switzerland Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	"	Solactive Core Switzerland Large & Mid Cap CHF Index NTR	Legal & General Investment Management Limited
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 Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	"	Foxberry Sustainability Consensus Europe TR Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	"	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 ESG China CNY Bond UCITS ETF	"	J.P. Morgan China Custom Liquid ESG Capped Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF	"	J.P. Morgan Government Bond Index (GBI) United Kingdom Short-term Custom Maturity 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 USD Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF <sup>3</sup>	"	J.P. Morgan Global Credit Index (GCI) ESG Investment Grade USD Short-Term Custom Maturity Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G ESG EUR Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF <sup>3</sup>	"	J.P. Morgan Global Credit Index (GCI) ESG Investment Grade EUR Short-Term Custom Maturity Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G ESG EUR Corporate Bond UCITS ETF <sup>3</sup>	"	J.P. Morgan Global Credit Index (GCI) ESG Investment Grade EUR 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
L&G ESG Green Bond UCITS ETF	"	J.P. Morgan ESG Green Bond Focus Index	Legal & General Investment Management Limited

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

<sup>3</sup> Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 22. Oktober 2020 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an den Fonds ausgegeben.

## Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

Name des Fonds	Fondsart	Indexname	Anlageverwalter / Unteranlageverwalter
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF	"	FTSE All Share ex IT 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 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 <sup>4</sup>	"	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 <sup>5</sup>	"	J.P. Morgan India Government Fully Accessible Route (FAR) Bonds Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Fonds mit synthetischer Nachbildung	LevDAX® x2 Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	"	ShortDAX® x2 Index	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 FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	"	FTSE 100® Daily Leveraged Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	"	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index	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 All Commodities UCITS ETF	"	Bloomberg Commodity Index Total Return	Legal & General Investment Management Limited
L&G Foxberry US Large Cap Floored UCITS ETF <sup>6</sup>	"	Foxberry Floored Beta US Large Cap @80% TR Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Foxberry EU Large Cap Floored UCITS ETF <sup>6</sup>	"	Foxberry Floored Beta EU Large Cap @80% TR Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Foxberry Germany Large Cap Floored UCITS ETF <sup>6</sup>	"	Foxberry Floored Beta Germany Large Cap @80% TR Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Foxberry Emerging Markets Floored UCITS ETF <sup>6</sup>	"	Foxberry Floored Beta Emerging Markets @80% TR Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF <sup>6</sup>	"	Bloomberg ex-Agriculture and Livestock 15/30 Capped 3 Month Forward Total Return Index	Legal & General Investment Management Limited
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>7</sup>	"	Barclays Backwardation Tilt Multi-Strategy Capped Total Return Index	Legal & General Investment Management Limited

<sup>4</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>5</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

<sup>6</sup> Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 23. Februar 2017 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an den Fonds ausgegeben.

<sup>7</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>8</sup> Dieser Fonds wurde am 14. Januar 2022 geschlossen.

## 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 Untermanager) 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 Anteilklassen, sofern sich der betreffende Fonds aus mehr als einer Anteilklasse zusammensetzt) am 30. Juni 2022 notiert waren.

Fonds/Anteilklasse	Deutsche Börse Extra	Euronext Amsterdam	Borsa Italiana	London Stock Exchange	SIX Swiss Exchange
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	X
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	✓	X	✓	✓	X
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	✓	X	✓	✓	X
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	X	X	X	✓	X
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	X	X	X	✓	X
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	X
L&G Gold Mining UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓
L&G Cyber Security UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓
L&G All Commodities UCITS ETF	✓	X	X	✓	X
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓

## Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Deutsche Börse Extra	Euronext Amsterdam	Borsa Italiana	London Stock Exchange	SIX Swiss Exchange
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓
L&G US Equity UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	X
L&G UK Equity UCITS ETF	X	X	X	✓	X
L&G Japan Equity UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	X
L&G Global Equity UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	X
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	X
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	X
L&G Clean Water UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	✓	X	✓	✓	X
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	✓	X	✓	✓	X
L&G Clean Energy UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	X	X	X	✓	✓
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	X	X	X	✓	✓
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF <sup>1</sup>	✓	X	✓	X	X
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF <sup>2</sup>	✓	X	X	X	X
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF	X	X	X	✓	X
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	X	X	X	✓	✓
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - EUR Hedged Accumulating ETF <sup>3</sup>	X	X	X	X	✓
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Accumulating ETF <sup>3</sup>	X	X	X	X	✓
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - GBP Hedged Distributing ETF <sup>4</sup>	X	X	X	✓	X
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Distributing ETF <sup>4</sup>	X	X	X	X	✓
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G ESG Green Bond UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF	X	X	X	✓	X
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	✓	X	✓	✓	X
L&G Digital Payments UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓

<sup>1</sup>Die Anteilklasse wurde am 6. Mai 2022 aufgelegt.<sup>2</sup>Die Anteilklasse wurde am 21. Juli 2021 aufgelegt.<sup>3</sup>Die Anteilklasse wurde am 20. August 2021 aufgelegt.<sup>4</sup>Die Anteilklasse wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

## Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Deutsche Börse Extra	Euronext Amsterdam	Borsa Italiana	London Stock Exchange	SIX Swiss Exchange
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>	✓	X	✓	✓	✓
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>2</sup>	X	X	X	✓	X
L&G India INR Government Bond UCITS ETF <sup>3</sup>	✓	X	✓	✓	✓

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>2</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>3</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

Die primäre Notierung der Anteile der Fonds erfolgt in der Regel am Hauptmarkt der Londoner Börse („LSE“) (obgleich einige Fonds primär an einer alternativen Börse notiert sein können). Alle anderen Notierungen nehmen neben der Primärnotierung einen sekundären Rang ein. Wir weisen darauf hin, dass die Fonds keine „Vorzugsnotierung“ an der LSE mehr haben und stattdessen am 4. Januar 2022 auf eine „Standardnotierung“ wechselten. Infolge dieser Änderung ergab sich keine Auswirkung auf den Abschluss.

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

Die Bezeichnung „Anlageverwalter“ bezieht sich kontextabhängig auf die GO ETF Solutions LLP bzw. 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 2022“ bezieht sich auf den zwölfmonatigen Berichtszeitraum vom 1. Juli 2021 bis zum 30. Juni 2022.

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 30.06.2022		Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2022	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2022	Nachbildungs- abweichung in %	Erwartete Tracking Error	Realisierter Tracking Error	Differenz
				Gesamt	Je Anteil	Veränderung in %	Indexveränderung in %				Tracking Error in Basispunkten
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	14.05.2014	0,88 %	31.978.263	19,0347	-14,13 %	-14,01 %	-0,12 %	0,70 %	0,53 %	17,23
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	18.06.2009	0,40 %	28.009.269	246,8538	-35,93 %	-35,01 %	-0,92 %	0,20 %	0,08 %	11,50
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	18.06.2009	0,60 %	44.471.185	2,1760	24,79 %	25,72 %	-0,92 %	0,20 %	0,08 %	11,98
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	15.03.2010	0,30 %	658.160.227	22,8779	27,59 %	28,06 %	-0,47 %	0,20 %	0,05 %	14,55
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	18.06.2009	0,50 %	17.948.005	303,8070	6,24 %	8,53 %	-2,29 %	0,20 %	0,06 %	13,50
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	18.06.2009	0,60 %	11.486.687	4,2189	-17,39 %	-16,53 %	-0,86 %	0,20 %	0,05 %	15,28
L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	11.09.2008	0,30 %	33.921.199	77,4869	-21,62 %	-21,57 %	-0,05 %	0,30 %	0,12 %	17,98
L&G Gold Mining UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	11.09.2008	0,65 %	127.216.429	25,7154	-23,39 %	-23,51 %	0,11 %	0,35 %	0,47 %	(11,82)
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>2</sup>	US\$	12.05.2014	0,25 %	30.849.810	4,4992	-0,22 %	0,61 %	-0,83 %	0,20 %	0,06 %	14,09
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	23.10.2014	0,80 %	801.871.883	17,9287	-30,81 %	-30,44 %	-0,37 %	0,45 %	0,13 %	31,68
L&G Cyber Security UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	22.09.2015	0,69 %	2.471.074.322	18,6839	-26,47 %	-25,36 %	-1,11 %	0,45 %	0,49 %	(4,49)
L&G All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	05.07.2017	0,15 %	106.096.458	14,6970	24,03 %	24,27 %	-0,23 %	0,20 %	0,03 %	16,95
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	18.01.2018	0,49 %	774.230.772	14,4716	-21,15 %	-21,11 %	-0,04 %	0,45 %	0,27 %	17,65
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	18.01.2018	0,49 %	33.957.492	10,9540	-17,04 %	-16,78 %	-0,26 %	0,35 %	0,08 %	27,13
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	18.01.2018	0,49 %	264.575.344	13,0443	-27,08 %	-26,84 %	-0,23 %	0,45 %	0,19 %	26,03
L&G US Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	07.11.2018	0,05 %	385.777.452	14,4223	-13,10 %	-13,29 %	0,19 %	0,30 %	0,06 %	24,03
L&G UK Equity UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	07.11.2018	0,05 %	45.243.834	11,4832	6,13 %	6,07 %	0,06 %	0,30 %	0,08 %	21,62

## Fondsbericht (Fortsetzung)

Anteilklasse	Währung	Auflegungs- datum	TER	NIW zum		Wertentwicklung	Wertentwicklung	Nachbildungs- abweichung in %	Erwarteter Tracking Error	Realisierter Tracking Error	Differenz zwischen dem erwarteten Tracking Error und dem realisierten Tracking Error in Basispunkten
				30.06.2022 Gesamt	30.06.2022 Je Anteil	für das Geschäftsjahr zum 30.06.2022 NIW/Anteil Veränderung in %	für das Geschäftsjahr zum 30.06.2022 Indexveränderung in %				
L&G Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	07.11.2018	0,10 %	282.173.048	10,4296	-19,75 %	-19,73 %	-0,02 %	0,30 %	0,12 %	18,48
L&G Global Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	07.11.2018	0,10 %	56.028.143	13,3400	-14,34 %	-14,53 %	0,19 %	0,30 %	0,13 %	16,90
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	07.11.2018	0,10 %	194.967.107	12,3341	-10,77 %	-11,06 %	0,29 %	0,30 %	0,16 %	14,12
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	07.11.2018	0,10 %	263.868.735	11,5655	-15,56 %	-15,53 %	-0,03 %	0,30 %	0,06 %	24,18
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	25.06.2019	0,49 %	309.086.103	12,9055	-18,57 %	-18,26 %	-0,31 %	0,45 %	0,11 %	34,07
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	26.06.2019	0,49 %	223.476.589	11,6191	-38,26 %	-38,04 %	-0,21 %	0,45 %	0,05 %	40,20
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	26.06.2019	0,49 %	125.221.037	11,9258	-39,38 %	-39,50 %	0,12 %	0,45 %	0,22 %	22,72
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	30.08.2019	0,16 %	92.121.663	11,7447	-9,82 %	-9,97 %	0,14 %	0,30 %	0,14 %	15,69
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	26.11.2019	0,12 %	859.813.276	12,7125	-14,69 %	-14,77 %	0,08 %	0,30 %	0,03 %	27,34
L&G Clean Energy UCITS ETF - USD Accumulating ETF <sup>3</sup>	US\$	05.11.2020	0,49 %	182.297.398	10,3578	-22,70 %	-18,46 %	-4,24 %	0,35 %	4,59 %	(424,21)
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF <sup>2</sup>	GBP	03.12.2020	0,09 %	68.896.293	9,4185	-5,32 %	-5,21 %	-0,12 %	1,00 %	0,07 %	92,80
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF - GBP Distributing ETF <sup>2</sup>	GBP	03.12.2020	0,09 %	84.670.827	8,4166	-13,63 %	-13,47 %	-0,16 %	1,00 %	0,10 %	90,12
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>2</sup>	US\$	03.12.2020	0,25 %	72.941.335	8,6113	-13,35 %	-14,01 %	0,66 %	1,00 %	0,82 %	18,35
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>2</sup>	US\$	03.12.2020	0,30 %	178.181.981	10,1525	0,45 %	0,74 %	-0,29 %	1,00 %	0,13 %	87,12
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	03.12.2020	0,06 %	21.649.346	9,6219	-3,29 %	-3,24 %	-0,05 %	0,50 %	0,03 %	47,22
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>2</sup>	US\$	15.01.2021	0,09 %	91.455.100	8,5472	-12,80 %	-12,70 %	-0,10 %	1,00 %	0,14 %	86,48
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>2</sup>	US\$	15.01.2021	0,35 %	290.854.357	8,5007	-13,52 %	-14,26 %	0,74 %	1,00 %	0,78 %	22,05
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	01.02.2021	0,49 %	496.926.950	5,4014	-39,02 %	-38,95 %	-0,07 %	0,45 %	0,16 %	28,86
L&G ESG Green Bond UCITS ETF - EUR Distributing ETF <sup>2</sup>	EUR	11.02.2021	0,25 %	8.143.600	8,4808	-13,75 %	-13,84 %	0,08 %	1,00 %	0,20 %	80,07
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF - GBP Distributing ETF <sup>2</sup>	GBP	12.04.2021	0,25 %	43.105.616	9,3632	-1,85 %	-1,82 %	-0,02 %	0,35 %	0,30 %	5,37

## Fondsbericht (Fortsetzung)

Anteilklasse	Währung	Auflegungs- datum	TER	NIW zum 30.06.2022 Gesamt	NIW zum 30.06.2022 Je Anteil	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2022 NIW/Anteil	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2022 Indexveränderung	Nachbildungs- abweichung in %	Erwarteter Tracking Error	Realisierter Tracking Error	Differenz zwischen dem erwarteten Tracking Error und dem realisierten Tracking Error
						Veränderung in %	in %				in Basispunkten
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF - EUR Distributing ETF <sup>2</sup>	EUR	12.04.2021	0,25 %	21.293.905	9,1230	-4,08 %	-4,35 %	0,27 %	0,35 %	0,29 %	5,61
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>2</sup>	US\$	12.04.2021	0,40 %	21.069.736	8,4279	-15,55 %	-15,10 %	-0,45 %	0,35 %	0,13 %	21,50
L&G Digital Payments UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	25.05.2021	0,49 %	11.594.359	5,6558	-45,92 %	-45,66 %	-0,26 %	0,35 %	0,12 %	22,60
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF <sup>1,3</sup>	US\$	02.07.2021	0,30 %	838.762.584	13,9744	39,20 %	39,94 %	-0,73 %	0,05 %	0,03 %	(65,71)
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>1,2</sup>	US\$	12.07.2021	0,45 %	15.856.377	8,3455	-13,99 %	-13,99 %	0,00 %	0,75 %	0,71 %	71,79
L&G India INR Government Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>1</sup>	US\$	26.10.2021	0,39 %	279.367.171	9,2200	-7,06 %	-6,53 %	-0,53 %	1,00 %	0,14 %	86,12

<sup>1</sup> Angaben zu NIW und Wertentwicklung beziehen sich auf den Berichtszeitraum vom angegebenen Auflegungsdatum der einzelnen Anteilklassen bis zum 30. Juni 2022.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung ist Total Return mit am Ex-Datum reinvestierten Dividenden.

<sup>3</sup> Der tatsächliche Tracking Error entspricht nicht dem erwarteten Tracking Error.

### L&G Clean Energy UCITS ETF – Der realisierte Tracking Error entspricht nicht dem erwarteten Tracking Error

Am 27. Juni 2022 zeigte Saipem Spa (SPM IM), ein im zugrunde liegenden Index des L&G Clean Energy UCITS ETF (der „Fonds“), dem Solactive Clean Energy Index (SOLCLNEN Index) (der „Index“), vertretenes Unternehmen, eine stark verwässernde Bezugsrechtsemission an, was aufgrund der unterschiedlichen Implementierung auf Fonds- und Indexebene einen erheblichen realisierten Tracking Error zur Folge hatte.

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 im Fonds eingebucht wurden.

## 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 2022

#### Wirtschaftlicher Überblick

In den vergangenen zwölf Monaten sorgten vor allem der Inflationsdruck und eine straffere Geldpolitik für Bedenken unter den Marktteilnehmern, und die Unterstützung der Zentralbanken aus der Pandemiezeit ist mittlerweile nur eine blasse Erinnerung. Die Befürchtungen über eine wirtschaftliche Abkühlung nehmen zu.

Trotz der Ängste vor einer steigenden Inflation bei kräftigem Wirtschaftswachstum und einer anhaltenden Zentralbankunterstützung beließ die US-Notenbank Federal Reserve (die „Fed“) die Zinsen in der ersten Jahreshälfte zunächst auf niedrigem Niveau. Das Gleiche galt für die Europäische Zentralbank. Die Bank of England (die „BoE“) erwies sich unterdessen mit einem Zinsschritt im Dezember als Vorreiterin. Obgleich die Daten zur Verbraucherpreisinflation in den USA auf einen raschen Anstieg hinwiesen, argumentierte die Fed wiederholt, dass die höhere Teuerungsrate nur vorübergehender Art sei und sie die Zinsen erst dann anheben würde, wenn die beiden Ziele einer nachhaltigen Inflation von 2% und einer maximalen Beschäftigung erreicht seien.

Nachdem die Fed in der zweiten Jahreshälfte jedoch mit der Drosselung ihres Notfall-Anleihenkaufprogramms begonnen hatte, bestätigte sie, dass die inflationären Kräfte nicht mehr als „vorübergehend“ zu charakterisieren sind und eine Straffung der Geldpolitik erforderlich war. Sie biss schließlich in den sauren Apfel und erhöhte im März die Zinsen. Im Mai kam es dann zu einer Anhebung auf einen Stand von 1 % und im Juni zu einem beträchtlichen Zinsschritt von 0,75 %. Am Jahresende verhartet die annualisierte Verbraucherpreisinflation in den USA unterdessen bei 9,1 %.

Trotz der zunehmenden Befürchtungen, dass die USA mittelfristig auf eine Rezession zusteuern könnten, hat die Fed mit ihrer Rhetorik in Bezug auf die Geldpolitik wenig dazu beigetragen, diese Bedenken zu zerstreuen. Der Fed-Vorsitzende Jerome Powell bekräftigte stattdessen, die Zentralbank würde die zinspolitische Straffung so lange fortsetzen, bis die Inflationsrate „eindeutige und überzeugende“ Anzeichen einer Rückkehr zu ihrem Zielwert von 2 % aufweist. Zudem gab er zu, dass ein etwaiger wirtschaftlicher Abschwung weitgehend von Faktoren abhängt, die außerhalb der Kontrolle der Fed liegen, wobei eine Rezession „sicherlich im Rahmen des Möglichen“ sei.

Die BoE legte vor Beginn des Geschäftsjahres als Erste unter den geldpolitischen Entscheidungsträgern in Industrieländern ihre Karten auf den Tisch und hob danach die Zinssätze im Geschäftsjahr nochmals in vier Schritten an, wobei im Juni bei einer Inflation von über 9 % ein 13-Jahreshoch von 1,25 % erreicht wurde.

Die Zeiten weit verbreiteter Wertpapierkaufprogramme der Zentralbanken neigen sich dem Ende zu. Lediglich die Bank of Japan scheint die letzte Bastion einer solchen quantitativen Expansion zu sein. Die Europäische Zentralbank („EZB“) setzte unterdessen die Ankäufe von Vermögenswerten im Rahmen des Pandemie-Notkaufprogramms bis Ende März fort und beendete das Programm im Anschluss daran. Die EZB hat sich bislang hartnäckig gegen eine Straffung der Geldpolitik gestraubt. Angesichts der in der gesamten Region grassierenden Inflation dürfte ihre Haltung aber kaum von Dauer sein. Eine erste Zinserhöhung im Juli 2022 scheint fest eingeplant, und eine weitere, größere Anhebung ist für September vorgesehen.

In der Zwischenzeit ließ Russlands Einmarsch in der Ukraine im Februar 2022 Befürchtungen über eine globale geopolitische Krise aufkommen, während die Auswirkungen auf den Energiesektor und für die Energiekunden unvermindert zu spüren sind.

#### Aktien

Nach einer besonders volatilen zweiten Jahreshälfte fielen die globalen Aktienindizes im vergangenen Jahr deutlich, da Inflationssorgen, die Aussicht auf eine straffere Geldpolitik und Rezessionsängste zunehmend negativ zu Buche schlugen.

Angesichts dessen schnitten britische Aktien im Zwölfmonatszeitraum deutlich besser ab als der weltweite Durchschnitt, angeführt von den im Energiesektor stark vertretenen Large Caps. Im gesamten Berichtszeitraum verloren sie aber trotzdem leicht an Boden.

Die US-Aktienmärkte entwickelten sich besser als der weltweite Durchschnitt, verbuchten aber dennoch merkliche Einbußen. Im vergangenen Jahr entwickelte sich der Energiesektor mit einem Plus (von beinahe 35 %) am besten. Versorgung, Basiskonsumgüter und das Gesundheitswesen erzielten ebenfalls positive Renditen. Kommunikationsdienste und Nicht-Basiskonsumgüter waren während des Zwölfmonatszeitraums die schwächsten Sektoren.

## Fondsbericht (Fortsetzung)

### Aktien (Fortsetzung)

Europäische Aktien entwickelten sich zu Beginn des Berichtszeitraums sehr gut, verloren aber in der zweiten Jahreshälfte deutlich an Wert, weshalb sie am Ende des Berichtszeitraums weit hinter dem weltweiten Durchschnitt und deutlich im negativen Bereich schlossen. Die Auswirkungen von Russlands Invasion in der Ukraine waren für die Anlageklasse besonders schädlich. Energie war der einzige Sektor, der in diesen zwölf Monaten mit einem Plus schloss. Der Sektor Reisen und Freizeit verzeichnete eine Durststrecke und war am schwächsten, während die Bereiche Immobilien, Autos und Autoteile sowie Technologie ebenfalls beklagenswerte zwölf Monate zu verbuchen hatten.

Die Aktienmärkte im Asien-Pazifik-Raum verzeichneten im Jahresverlauf negative Renditen und blieben hinter dem weltweiten Durchschnitt zurück. Hier beeinträchtigte China die Entwicklung. Die Daten legen nahe, dass der chinesischen Wirtschaft eine unangenehme Zeit bevorsteht: Die offiziellen BIP-Zahlen sind im historischen Vergleich bescheiden, und die Auswirkungen der strengen COVID-19-Beschränkungen, mit denen das Land an seiner Null-COVID-Politik festhält, fügen der Wirtschaft unvermindert Schaden zu. Verschärft wurde diese Lage durch strengere staatliche Vorschriften in einer Reihe von Sektoren, insbesondere im Immobilien- und im Technologiesektor in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums. Ungeachtet einer Schwächeperiode gegen Ende des Berichtszeitraums verbuchte Indien stattdessen eine positive Entwicklung in den vergangenen zwölf Monaten.

Die Märkte der Schwellenländer taten sich über die zwölf Monate sehr schwer. Obwohl viele im Zuge besserer Verbrauchsprognosen von einem höheren Ölpreis profitierten, belastete der Anstieg des US-Dollars gegenüber den Währungen der Schwellenländer die Renditen. 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 über eine wirtschaftliche Abkühlung und wegen regulatorischer Bedenken zu massiven Ausverkäufen, wodurch das Land den Index belastete.

Russland fiel Anfang März 2022 nach seinem Einmarsch in die Ukraine aus den MSCI-Indizes. Der Indexanbieter bezeichnete den dortigen Aktienmarkt in Anbetracht der lähmenden Sanktionen, die seit Beginn des Konflikts gegen das Land verhängt wurden, als „nicht investierbar“.

### Anleihen

Die Renditen auf Staatsanleihen stiegen an, da das seit der Pandemie nun erstmals wieder festere wirtschaftliche Umfeld zunächst dazu führte, dass Anleger Aktien den Vorzug gaben. Allerdings flaute dieser Anstieg zur Mitte des Berichtszeitraums aufgrund von Inflationssorgen und der Rückkehr der pandemiebedingten Risikoaversion ab, bevor er wieder an Fahrt aufnahm, als der Inflationsdruck und anschließend die geldpolitischen Straffungsmaßnahmen die Oberhand gewannen.

In den ersten Monaten des Berichtszeitraums führten steigende BIP-Raten in den Industrieländern in Verbindung mit einer beispiellos lockeren Geldpolitik dazu, dass man in den kommenden Monaten von einer anhaltenden Inflation ausging, was Anleihen generell belastete. Die Renditen auf US-Treasuries stiegen infolge der boomenden US-Wirtschaft stark an, während die Renditen europäischer und britischer Staatsanleihen ebenfalls zulegten. Dessen ungeachtet äußerte die EZB, sie werde steigenden Fremdkapitalkosten aktiv entgegenwirken, um die Unternehmen der Region zu entlasten, damit der fragile Konjunkturaufschwung weiterlaufen könne. Die Renditen auf US-Treasuries stiegen zu Beginn des Berichtszeitraums lediglich aufgrund von Zusicherungen der Fed, dass keine zinspolitischen Änderungen bevorstehen würden, bis sich die Beschäftigungslage wieder auf Niveaus vor der Pandemie erholt habe, leicht an. In der zweiten Hälfte stiegen sie dann stark, da der Inflationsdruck weiter zunahm und die Fed mit ihrem Zinserhöhungszyklus begann.

Die Spreads von Anleihen mit Investment Grade in den USA, im Vereinigten Königreich und in Europa folgten bis kurz vor Ende des Berichtszeitraums de facto den Renditen der zugrunde liegenden Staatsanleihen, bis es schließlich zu einer Ausweitung kam. Bei Hochzinsanleihen kam es während des gesamten Berichtszeitraums zu Spread-Ausweitungen, die durch die Invasion Russlands in die Ukraine noch verstärkt wurden.

Der deutliche Anstieg im US-Dollar während des größten Teils des Berichtszeitraums sorgte zudem dafür, dass sich die Anleger um die Kreditkosten der Schwellenländer sorgten.

## Fondsbericht (Fortsetzung)

### Immobilien

Auf dem britischen Gewerbeimmobilienmarkt gab es weiterhin Anzeichen einer Erholung. Im vergangenen Jahr waren bei der Vermietung von Büroflächen solide Zuwachsraten zu verzeichnen, da die Mitarbeiter ins Büro zurückkehren, und das Interesse der Anleger an britischen Büroimmobilien nimmt weiter zu. Die Diskussion über künftige Büropräsenz hält unterdessen an. Andernorts bleiben die Renditen im Einzelhandel stabil, während sie bei Einkaufszentren Anzeichen für eine Abschwächung aufweisen. Letztlich sei erwähnt, dass sich der britische Wohnimmobilienmarkt trotz der Abschaffung der staatlichen Unterstützung weiterhin robust zeigt, was vor allem auf den anhaltenden Druck von der Angebotsseite zurückzuführen ist.

September 2022

## 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 aufbrachten 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 vom britischen Financial Reporting Council im Juli 2018 herausgegebene britische Corporate Governance Code (der „UK-Code“) und der Companies Act 2014 verlangen vom Verwaltungsrat ferner, sicherzustellen, dass der Jahresbericht und der Jahresabschluss in ihrer Gesamtheit fair, ausgewogen und verständlich sind 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 2022 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 2022 bzw. 30. Juni 2021 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) <sup>(1) (2)</sup>

Howie Li (Brite)

Patrizia Libotte (Irin)

David Fagan (IRE) <sup>(1)</sup>

Donard McClean (IRE) <sup>(1)</sup>

<sup>(1)</sup> Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

<sup>(2)</sup> 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 2022 bzw. 30. Juni 2021 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

Gemäß Section 225 des irischen Companies Act von 2014 bestätigt der Verwaltungsrat der Gesellschaft, dass er dafür verantwortlich ist, dass die Gesellschaft ihre „maßgeblichen Verpflichtungen“ erfüllt. Der Begriff „maßgebliche Verpflichtungen“ (Relevant Obligations) ist in Section 225 des Companies Act definiert.

Die Gesellschaft verfolgt den Grundsatz, die Erfüllung ihrer maßgeblichen Verpflichtungen sicherzustellen und ein Unternehmensumfeld zu fördern, in dem das Bewusstsein für eine Kultur der Einhaltung dieser maßgeblichen Verpflichtungen und ihre Förderung gestärkt wird. Dementsprechend hat der Verwaltungsrat der Gesellschaft eine Erklärung zur Compliance-Politik eingeführt, in der die Richtlinien der Gesellschaft in Bezug auf die Einhaltung ihrer maßgeblichen Verpflichtungen dargelegt werden (die „Erklärung zur Compliance-Politik“).

Um der Erklärung zur Compliance-Politik Wirkung zu verschaffen, hat der Verwaltungsrat der Gesellschaft mit Unterstützung seiner Dienstleister und Berater die maßgeblichen Verpflichtungen ermittelt, die seiner Auffassung nach für die Gesellschaft gelten, und hat Vorkehrungen getroffen und Strukturen mit dem Ziel geschaffen, dass diese Verpflichtungen im Wesentlichen erfüllt werden (die „Compliance-Vorkehrungen“). Im Berichtsjahr wurde vom Verwaltungsrat der Gesellschaft keine Überprüfung der Compliance-Vorkehrungen durchgeführt und dokumentiert.

Die Gesellschaft hat die Erklärung zur Compliance-Politik und die Compliance-Vorkehrungen umgesetzt, und der Verwaltungsrat hat die Compliance-Vorkehrungen am 23. September 2022 im Rahmen seiner Prüfung des Jahresabschlusses der Gesellschaft zum 30. Juni 2022 überprüft. Infolge eines administrativen Versehens fand die Überprüfung außerhalb des Geschäftsjahres statt. Die Erklärung zur Compliance-Politik und die Compliance-Vorkehrungen werden einer jährlichen Überprüfung unterzogen, um festzustellen, ob sie weiterhin angemessen gewährleisten, dass die Gesellschaft ihre maßgeblichen Verpflichtungen in jeder wesentlichen Hinsicht erfüllt.

### 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.

Die Gesellschaft hat freiwillig den von Irish Funds im Dezember 2011 veröffentlichten „Corporate Governance Code for Collective Investment Schemes and Management Companies“ (Unternehmensführungskodex für Organismen für gemeinsame Anlagen und Verwaltungsgesellschaften – „IF-Code“) übernommen, der abrufbar ist unter: <http://www.irishfunds.ie/publications/>. 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;

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### A. Allgemeine Anforderungen (Fortsetzung)

- IV. dem britischen, vom Financial Reporting Council im Juli 2018 herausgegebenen Corporate Governance Code (der „UK-Code“), der zur Verfügung steht unter: <https://www.frc.org.uk/Our-Work/Codes-Standards/Corporate-governance/UK-Corporate-Governance-Code.aspx>; und
- V. 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>.

Um den anwendbaren Bestimmungen der Corporate-Governance-Anforderungen Rechnung zu tragen, hat der Verwaltungsrat der Gesellschaft einen Corporate-Governance-Rahmen geschaffen, der nach seiner Meinung für eine offene Investmentgesellschaft angemessen ist, die börsengehandelte Indexfonds auflegt.

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 alleinige Ziel der Gesellschaft besteht in der gemeinsamen Anlage von auf dem Kapitalmarkt aufgebrauchten Geldern gemäß den speziellen Anlagezielen/Anlagestrategien der einzelnen Fonds, die vom Verwaltungsrat zum Zeitpunkt der Auflegung der einzelnen 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. Die Gesellschaft unterliegt nicht den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (betreffend Übernahmeangebote (Richtlinie 2004/25/EG)) von 2006.

Bestimmte Fonds der Gesellschaft hatten bis zum 4. Januar 2022 eine Vorzugsnotierung am Hauptmarkt der London Stock Exchange, weshalb der UK-Code Anwendung fand. Am 4. Januar 2022 wurden die Fonds der Gesellschaft automatisch auf das Standardnotierungssegment des Hauptmarktes der London Stock Exchange umgestellt. Die Gesellschaft wandte weiterhin den UK-Code an, bis die Anwendung durch den Verwaltungsrat auf seiner Sitzung am 29. September 2022 beendet wurde.

Unter Einhaltung des im UK-Code vorgesehenen „Comply-or-Explain“-Ansatzes wandte die Gesellschaft die wesentlichen Grundsätze des UK-Code an, insofern der Verwaltungsrat der Gesellschaft diese als relevant und angemessen für eine offene Investmentgesellschaft erachtete, die börsengehandelte Indexfonds auflegt. Entsprechend liefert der Verwaltungsrat der Gesellschaft eine Erklärung, wenn er bestimmte Aspekte im UK-Code nicht für relevant hält. Im Berichtsjahr entsprachen die Corporate-Governance-Praktiken der Gesellschaft generell den wesentlichen Grundsätzen des UK-Code.

Folgendes wurde vom Verwaltungsrat der Gesellschaft in Bezug auf die Anwendung des UK-Code bei einem offenen Organismus für gemeinsame Anlagen, der börsengehandelte Indexfonds begibt, für nicht zutreffend oder relevant erachtet:

- die Ernennung und die Aufgaben des Chief Executive;
- die Anforderung, dass der Vorsitzende bei seiner Berufung unabhängig ist;
- die Notwendigkeit der Einrichtung eines Vergütungsausschusses;
- die Notwendigkeit der Einrichtung eines Nominierungsausschusses;
- die Ernennung eines einzelnen Senior Independent Director;

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### A. Allgemeine Anforderungen (Fortsetzung)

- die Ernennung eines dritten unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieds in den Prüfungsausschuss;
- die Anforderung, dass mindestens die Hälfte des Verwaltungsrats aus unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern bestehen muss; und
- die Wiederwahl von Verwaltungsratsmitgliedern.

#### B. Vom UK-Code geforderte Haftungserklärung

Jedes Verwaltungsratsmitglied, dessen Name und Funktion auf den Seiten 21 bis 23 in diesem Jahresbericht aufgeführt ist, bestätigt, dass nach bestem Wissen und Gewissen der einzelnen Personen:

- der gemäß den EU-IFRS aufgestellte Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und Finanzlage der Gesellschaft zum 30. Juni 2022 und des Rückgangs des Nettovermögens, das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile für das dann beendete Geschäftsjahr zuzurechnen ist, vermittelt;
- der im Jahresbericht enthaltene Bericht des Verwaltungsrats (Lagebericht) eine zutreffende Darstellung der Geschäfts- und Ertragsentwicklung sowie der Lage der Gesellschaft zusammen mit einer Beschreibung der wichtigsten Risiken und Ungewissheiten, denen sie ausgesetzt ist, enthält; und
- der Jahresbericht und der Jahresabschluss 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.

#### C. 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.

Die Gesellschaft hat keinen Senior Independent Director bestellt. Der Verwaltungsrat geht davon aus, dass die Gesellschaft als offene Investmentgesellschaft keinen Senior Independent Director bestellen muss. Gemäß irischer Rechtsvorschriften und Corporate-Governance-Praktiken ist die Bestellung eines Senior Independent Director nicht erforderlich. Die Position des Vorsitzenden wird im Rahmen der jährlichen Leistungsevaluierung des Verwaltungsrats und der einzelnen Verwaltungsratsmitglieder jährlich überprüft. Der Vorsitzende wird eigens von den unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern überprüft.

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.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 1. Zusammensetzung des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

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 Head of ETFs 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.

- 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.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 1. Zusammensetzung des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

- 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.

##### 2. Unabhängigkeit der Verwaltungsratsmitglieder

Die Empfehlungen vom UK-Code und vom IF-Code sind in Bezug auf die Zusammensetzung des Verwaltungsrats unterschiedlich. Der UK-Code schreibt vor, dass mit Ausnahme des Vorsitzenden mindestens die Hälfte des Verwaltungsrats aus nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern bestehen muss, die vom Verwaltungsrat für unabhängig befunden wurden, und zudem ein Senior Independent Director bestellt werden muss. Der IF-Code schreibt vor, dass die Mehrheit des Verwaltungsrats aus nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern bestehen muss, von denen mindestens einer ein unabhängiges nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied sein muss. Die Gesellschaft hat fünf nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder, von denen drei unabhängig sind. Die aktuelle Zusammensetzung des Verwaltungsrats geht somit über die Anforderung des IF-Code von mindestens einem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied hinaus, erfüllt aber nicht das vom UK-Code vorgeschriebene Minimum von drei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern und die Bestellung von einem Senior Independent Director.

Da der IF-Code jedoch speziell auf offene Investmentgesellschaften in Irland zugeschnitten wurde, vertritt der Verwaltungsrat die Auffassung, dass die aktuelle Zusammensetzung des Verwaltungsrats in Bezug auf die Unabhängigkeit der Urteilsfähigkeit ausgewogen genug ist und den Branchenerwartungen entspricht.

Sämtliche Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführend, und es wurde kein Chief Executive Officer im Verwaltungsrat bestellt.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 2. Unabhängigkeit der Verwaltungsratsmitglieder (Fortsetzung)

Im Einklang mit dem UK Code hat der Verwaltungsrat die Unabhängigkeit von Herrn Dempsey, Herrn Fagan und Herrn McClean geprüft. Es wurde festgestellt, dass sie als unabhängige Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft erachtet werden können, da sie als in ihrem Charakter und ihrer Urteilsfähigkeit unabhängig befunden wurden und diesbezüglich keine Beziehungen und Umstände vorliegen, welche die Urteilsfähigkeit dieser Verwaltungsratsmitglieder beeinträchtigen können.

##### 3. 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 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.

##### 4. Versicherung

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

##### 5. Bestellung

Der Verwaltungsrat ist verantwortlich für die Überprüfung der Größe, Struktur und Zusammensetzung des Verwaltungsrats und für die Erwägung von Änderungen oder Neubestellungen. Aufgrund der Größe des Verwaltungsrats hat der Verwaltungsrat keinen Nominierungsausschuss eingerichtet, weil die Aufgabe der Prüfung von Kandidaten zur Besetzung frei gewordener Sitze im Verwaltungsrat vom Verwaltungsrat in seiner Gesamtheit ausgeübt wird. 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.

Sämtliche Verwaltungsratsmitglieder haben Bestellungsschreiben mit der Gesellschaft, die Einzelheiten zu ihrem erwarteten Zeitaufwand enthalten. Auszüge aus den Bestellungsschreiben der Verwaltungsratsmitglieder können am eingetragenen Sitz der Gesellschaft eingesehen werden und stehen auf Anfrage auf der JHV zur Verfügung. Neben den Bestellungsschreiben haben die unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder auch Dienstverträge mit der Gesellschaft im Zusammenhang mit ihren Bestellungen in den Verwaltungsrat der Gesellschaft. Auszüge davon können am eingetragenen Sitz der Gesellschaft eingesehen werden und stehen auf Anfrage auf der JHV zur Verfügung.

##### 6. Leistungsevaluierung

Die Leistung eines jeden Verwaltungsratsmitglieds, des Verwaltungsratsvorsitzenden und des Verwaltungsrats in seiner Gesamtheit wurde mittels eines förmlichen jährlichen Evaluierungsprozesses in Bezug auf das Kalenderjahr 2021 bewertet.

Herr David Fagan und Herr Donard McClean wurden am 31. März 2021 zum Vorsitzenden beziehungsweise zum Mitglied des Prüfungsausschusses berufen (die „Mitglieder des Prüfungsausschusses“). Die förmliche jährliche Überprüfung der Leistung der Mitglieder des Prüfungsausschusses für das Jahr 2021 wurde noch nicht durchgeführt, soll aber am 26. Oktober 2022 erfolgen.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 6. Leistungsevaluierung (Fortsetzung)

Die Leistung des Verwaltungsrats in seiner Gesamtheit für das Kalenderjahr 2021 ist grundlegend im Wege eines förmlichen jährlichen Evaluierungsprozesses bewertet worden. Bislang haben sich keine wesentlichen Fragen ergeben. Der Verwaltungsrat hat bereits erste Gespräche über die Evaluierung geführt und wird die Gesamtergebnisse auf der Verwaltungsratssitzung im vierten Quartal 2022 erörtern.

Im Hinblick auf die Evaluierung eines jeden einzelnen Verwaltungsratsmitglieds erstellt der Vorsitzende eine erste Überprüfung eines jeden Verwaltungsratsmitglieds und bespricht (ggf.) die jeweilige Leistung mit dem einzelnen Verwaltungsratsmitglied. Anschließend präsentiert der Vorsitzende seine Ergebnisse dem Verwaltungsrat, die dann in einer offenen Gesprächsrunde diskutiert werden.

Im Hinblick auf die Evaluierung des Vorsitzenden hat ein unabhängiges nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied eine erste Beurteilung des Vorsitzenden erstellt und kann dessen Leistung ggf. mit ihm besprechen. Anschließend präsentiert das unabhängige nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglied dem Verwaltungsrat die Ergebnisse, die dann in einer offenen Gesprächsrunde diskutiert werden. Die Verwaltungsratsmitglieder werden dazu ermutigt, weitere Themen, die nicht bereits in den ersten Ergebnissen offensichtlich wurden, anzusprechen und Vorschläge für Änderungen oder Verbesserungen zu unterbreiten.

##### 7. Wiederwahl und Amtszeit

Ein Verwaltungsratsmitglied, das um ein freies Amt zu besetzen oder als zusätzliches Verwaltungsratsmitglied vom Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt worden ist, hat das Amt nur bis zum Schluss der JHV inne, die als nächstes auf diese Bestellung folgt, es sei denn es wird auf einer solchen JHV wiedergewählt oder es ist per ordentlichem Beschluss der Gesellschaft vor dieser JHV wiedergewählt worden.

Die Satzung der Gesellschaft sieht kein Ausscheiden von Verwaltungsratsmitgliedern aus Altersgründen und auch keine Ablösung von Verwaltungsratsmitgliedern durch Rotation vor. Der UK-Code sieht eine jährliche Wiederwahl aller Verwaltungsratsmitglieder vor. Die Verwaltungsratsmitglieder werden weder durch Rotation abgelöst noch für eine bestimmte Amtszeit ernannt. Die Gesellschaft erfüllt diese Bestimmung angesichts dessen nicht, dass die laufende Bestellung von Verwaltungsratsmitgliedern von einer kontinuierlich zufriedenstellenden Leistung abhängig ist, die im Rahmen der jährlichen Leistungsbeurteilung des Verwaltungsrats und der einzelnen Verwaltungsratsmitglieder überprüft wird.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 8. Einführung und Schulung von Verwaltungsratsmitgliedern

Vor seiner Ernennung erhält jedes neue Verwaltungsratsmitglied eine umfassende und offizielle, auf sein Amt zugeschnittene Einführung mit allen relevanten Informationen über die Gesellschaft und über seine Pflichten und Aufgaben als Verwaltungsratsmitglied. Darüber hinaus muss ein neues Verwaltungsratsmitglied eine gewisse Zeit mit Vertretern der Vertriebsstelle und des Anlageverwalters verbringen, so dass das neue Verwaltungsratsmitglied sich mit den verschiedenen Verfahren vertraut machen kann, die die Vertriebsstelle und der Anlageverwalter für die Ausübung ihrer/seiner Pflichten und Aufgaben gegenüber der Gesellschaft für nötig erachten.

##### 9. Häufigkeit von und Teilnahme an Verwaltungsratssitzungen

Der Verwaltungsrat tritt vierteljährlich zusammen, um seine Aufgaben zu erfüllen und das Geschäft der Gesellschaft zu prüfen sowie Angelegenheiten zu erörtern, deren Prüfung speziell dem Verwaltungsrat vorbehalten ist. Es können jedoch zusätzlich zu diesen vier vierteljährlichen Sitzungen nach Bedarf weitere Sitzungen einberufen werden, und der Verwaltungsrat kann häufiger in allgemeinen Sitzungen zusammentreten, um Angelegenheiten zu erörtern, die für die Gesellschaft allgemein von Bedeutung sind.

Materialien des Verwaltungsrats, einschließlich einer detaillierten Tagesordnung für jede Verwaltungsratssitzung, des Protokolls der vorangegangenen Sitzung und regelmäßiger Berichte der Bevollmächtigten, werden vor der Sitzung verteilt, um den Verwaltungsratsmitgliedern ausreichend Zeit zu geben, sich mit den Materialien zu befassen.

Das Quorum, das für die Abwicklung eines Tagesordnungspunktes auf einer Sitzung des Verwaltungsrats erforderlich ist, beträgt zwei.

Verwaltungsratsmitglied	7. Oktober 2021*	8. Dezember 2021*	24. Februar 2022 (Ad-hoc)*	10. März 2022*	20. Mai 2022 (Ad-hoc)*	15. Juni 2022
Feargal Dempsey	J	J	J	J	J	J
Howie Li	J	J	J	J	J	J
David Fagan	J	J	J	J	J	J
Donard McClean	J	J	J	J	J	J
Patrizia Libotte	J	J	J	J	J	J

\*Verwaltungsratssitzungen wurden aufgrund der geltenden Einschränkungen in Ländern mit der Covid-Pandemie virtuell abgehalten.

Wenn Verwaltungsratsmitglieder Bedenken in Bezug auf die Führung der Gesellschaft oder eine vorgeschlagene Maßnahme haben, die nicht ausgeräumt werden können, wird von ihnen erwartet, dass sie diese Bedenken auf den maßgeblichen Verwaltungsratssitzungen äußern und sicherstellen, dass diese Bedenken im offiziellen Verwaltungsratsprotokoll festgehalten werden. Beim Ausscheiden aus dem Verwaltungsrat sollte ein nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied dem Vorsitzenden eine schriftliche Erklärung zur Verteilung an den Verwaltungsrat einreichen, falls es derartige Bedenken hat.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 10. Ausschüsse des Verwaltungsrats

###### Prüfungsausschuss

Im März 2014 richtete die Gesellschaft einen Prüfungsausschuss ein (der „Prüfungsausschuss“), der sich aus den zwei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern, Eimear Cowhey und Adrian Waters, zusammensetzte, die jeweils am 31. März 2021 zurücktraten. Adrian Waters war bis zum 31. März 2021 Vorsitzender des Prüfungsausschusses. Aktuell setzt sich der Prüfungsausschuss aus Donard McClean und David Fagan zusammen. Letzterer führt seit 31. März 2021 den Vorsitz. 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.

##### 11. 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.

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.

##### 12. 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.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. 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“).

Der vorstehenden Delegierung 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).

Eine ausführliche Beschreibung des von der Verwaltungsgesellschaft für die fortlaufende Überwachung und Überprüfung der Risikomanagement- und internen Kontrollsysteme der Bevollmächtigten etablierten Rahmens ist im Abschnitt 3 „Der Überwachungsrahmen der Verwaltungsgesellschaft für die Risikokontrolle“ enthalten.

##### 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“ und dem Bericht des Prüfungsausschusses auf den Seiten 49 bis 52.

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;

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

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

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

- 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 Anteilhaber 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.

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.

Insbesondere und wie im nachstehenden Abschnitt 4 „Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft“ ausführlicher dargelegt, hat der Verwaltungsrat der Gesellschaft eine wirksame Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft durchgeführt, einschließlich solcher Risiken, die eine Gefahr für das Geschäftsmodell, den künftigen Erfolg, die Zahlungsfähigkeit und/oder Liquidität darstellen könnten, und hat sich vergewissert, dass die vorhandenen internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme des Geschäfts der Gesellschaft weiterhin angemessen sind, um diese Risiken zu steuern und/oder zu mindern.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

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

Wie im obigen Abschnitt D.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 2014 und entsprechend dem UK-Code richtete die Gesellschaft im März 2014 einen Prüfungsausschuss ein, der sich aus den zwei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern Adrian Waters und Eimear Cowhey (zusammen der „Prüfungsausschuss“) zusammensetzte. Sie traten beide am 31. März 2021 zurück. Aktuell setzt sich der Prüfungsausschuss aus Donard McClean und Dave Fagan zusammen, der zum Vorsitzenden des Prüfungsausschusses ernannt wurde. Dessen Bericht in Bezug auf das Geschäftsjahr ist im „Bericht des Prüfungsausschusses“ auf den Seite 49 bis 52 zu finden.

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;

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

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

###### Prüfungsausschuss (Fortsetzung)

- 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 Vertriebsstelle und Vertreter der Abschlussprüfer gehören.

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 dieser fair, ausgewogen und verständlich ist und Anteilinhabern die Informationen liefert, die notwendig sind, um die Ergebnisentwicklung und Geschäftsstrategie der Gesellschaft bewerten zu können.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

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

###### Prüfungsausschuss (Fortsetzung)

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.

##### 3. Der Überwachungsrahmen der Verwaltungsgesellschaft für die Risikokontrolle

Die alleinige Aufgabe der Verwaltungsgesellschaft besteht darin, als Verwaltungsgesellschaft in Bezug auf die Gesellschaft (d. h. nicht in Bezug auf andere offene Investmentgesellschaften in der Unternehmensgruppe von L&G oder anderweitig) tätig zu sein. Da die Verwaltungsgesellschaft keine Beschäftigten hat, sind die betrieblichen Aufgaben der Verwaltungsgesellschaft wie nachstehend ausführlicher beschrieben an verschiedene Konzernunternehmen von L&G und externe Dienstleister delegiert worden.

Die Verwaltungsgesellschaft ist eine Gesellschaft mit beschränkter Haftung, die am 29. Februar 2008 in Irland unter der Registernummer 454170 gegründet wurde. Sie ist eine hundertprozentige Tochtergesellschaft von LGIMH und eine Konzerngesellschaft der L&G-Unternehmensgruppe.

Wie im obigen Abschnitt D beschrieben hat der Verwaltungsrat der Gesellschaft das Management und die Verwaltung der Gesellschaft, einschließlich der Überwachung und Beurteilung interner Kontrollen und Risiken (außer im Zusammenhang mit der Finanzberichterstattung) an die Verwaltungsgesellschaft delegiert. Der Verwaltungsrat der Gesellschaft behält es sich vor, bei Bedarf selbst Richtlinien und/oder Anweisungen im Zusammenhang mit der Ausübung des Geschäfts der Gesellschaft vorzugeben bzw. zu erteilen.

Die Verwaltungsgesellschaft wiederum hat das Management und die Verwaltung der Geschäfte der Gesellschaft an die nachstehenden Bevollmächtigten delegiert:

###### *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.

Der vorherige Anlageverwalter war GO ETF Solutions LLP. Legal & General Investment Management Limited fungierte davor ausschließlich als Anlageverwalter für in festverzinsliche Wertpapiere investierte Teilfonds.

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 Anteilinhabern 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.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

##### 3. Der Überwachungsrahmen der Verwaltungsgesellschaft für die Risikokontrolle (Fortsetzung)

###### *Unteranlageverwalter*

Der Anlageverwalter hat an die E Fund Management (Hong Kong) Co., Limited auf diskretionärer Basis alle Befugnisse, Pflichten und Ermessensfreiheiten delegiert, die in Bezug auf das Management und die Anlage der Vermögenswerte des L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF (der „China Fund“) auszuüben sind, einschließlich des täglichen Managements der mit den Anlagen verbundenen Risiken. E Fund Management (Hong Kong) Co., Limited hat ihren Sitz in Hongkong und eine Zulassung für die Durchführung von regulierten Aktivitäten des Typs 1 (Handel mit Wertpapieren), 4 (Wertpapierberatung) und 9 (Vermögensverwaltung) von der Securities and Futures Commission von Hongkong.

Der Anlageverwalter behält die Aufsicht über die Anlage- und Risikomanagementaufgaben, die er an die einzelnen Unteranlageverwalter delegiert hat. Der Anlageverwalter erhält regelmäßig Berichte von den einzelnen Unteranlageverwaltern, die in seine eigenen regelmäßigen Berichte an die Verwaltungsgesellschaft aufgenommen werden und Bestandteil davon sind.

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

###### *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 Anteilinhabern 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.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

#### 3. Der Überwachungsrahmen der Verwaltungsgesellschaft für die Risikokontrolle (Fortsetzung)

##### Überwachung und Überprüfung durch die 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.

##### 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.

#### 4. Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft

Gemäß Ziffer 25 des britischen Corporate Governance Code von 2018 kann der Verwaltungsrat bestätigen, dass er mindestens einmal pro Jahr eine umfassende Beurteilung der Hauptrisiken durchgeführt hat, die sich der Gesellschaft stellen, darunter jene, die eine Gefährdung ihres Geschäftsmodells, der zukünftigen Wertentwicklung, Solvenz und Liquidität darstellen könnten. Die vom Verwaltungsrat ermittelten Hauptrisiken sind nachstehend zusammen mit einer Erklärung dargelegt, wie diese Risiken gehandhabt und reduziert werden.

##### Fondsrisiko (d. h. anlagebezogenes Risiko)

Alle Anlagen in Fonds der Gesellschaft gehen mit gewissen Risiken einher. Eine ausführlichere Beschreibung der mit den Fondsanlagen einschließlich der Finanzinstrumente, in die die Fonds investieren, verbundenen Risiken entnehmen Sie bitte Anmerkung 12.

##### Kreditrisiko

Das Kreditrisiko ist das Risiko, dass ein Emittent eines von einem Fonds erworbenen Wertpapiers seinen Zahlungsverpflichtungen nicht nachkommen könnte (z. B., indem er Zins- oder Tilgungszahlungen bei Fälligkeit nicht leistet). Kommt es zu einem Zahlungsausfall eines Emittenten, verliert der betreffende Fonds Geld.

Das Kreditrisiko beinhaltet auch das Risiko, dass ein Kontrahent eines Geschäfts, an dem ein Fonds beteiligt ist (etwa ein Kontrahent eines derivativen Finanzinstruments) seinen Zahlungsverpflichtungen nicht nachkommen könnte. Dadurch könnte ein Fonds einen Geldbetrag in Höhe des Werts der säumigen Zahlungsverpflichtung verlieren sowie ihm der Nutzen der Transaktion entgehen oder der Fonds könnte davon abgehalten werden, andere Wertpapiere zu verkaufen oder zu kaufen, um seine Anlagestrategie umzusetzen.

Das Kreditrisiko wird in Anmerkung 12 zum Jahresabschluss genauer erörtert.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

##### 4. Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft (Fortsetzung)

#### Fondsrisiko (d. h. anlagebezogenes Risiko) (Fortsetzung)

##### Liquiditätsrisiko

Das Liquiditätsrisiko bezieht sich auf die Liquidität der von den Fonds gehaltenen Vermögenswerte und auf die Fähigkeit der Gesellschaft, solche Vermögenswerte leicht zu veräußern, um Rücknahmeanträge von Anlegern gemäß Vorschrift 104 der OGAW-Vorschriften zu erfüllen. Um das Liquiditätsrisiko zu mindern, überwacht der Anlageverwalter die Liquidität der Vermögenswerte der Fonds fortlaufend.

Die Gesellschaft behält sich ferner die Möglichkeit vor, die täglichen Rücknahmeanträge für einen Fonds zu begrenzen, wenn sie an einem bestimmten „Handelstag“ (wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft definiert) 10 % des NIW des betreffenden Fonds übersteigen. Diese Befugnis wurde dem Anlageverwalter zur Entscheidung im Einzelfall übertragen. Unter diesen Umständen würde jeder am jeweiligen Handelstag eingehende Rücknahmeantrag anteilig reduziert, sodass die Gesamtzahl der Anteile des betreffenden Fonds, die am betreffenden Handelstag zurückgenommen werden, 10 % des NIW dieses Fonds nicht übersteigt. Jeder Teil eines Rücknahmeantrags, der aufgrund der Ausübung dieses Rechts nicht wirksam geworden ist, wird so behandelt, als ob ein auf den nächsten und jeden nachfolgenden Handelstag bezogener Antrag gestellt wurde, bis die ursprünglichen Anträge vollständig erfüllt worden sind.

##### Transferrisiko

Das Transferrisiko ist das Risiko, dass der Fonds eine geplante Anlage in einem bestimmten Land nicht tätigen und/oder die Erlöse aus dem Verkauf einer Transaktion aus diesem Land nicht zurückführen kann, weil die maßgebliche Regierungs-, Regulierungs- oder sonstige Aufsichtsbehörde eine diesbezügliche Beschränkung auferlegt. So kann beispielsweise eine Regierung ihre Währung als nicht konvertierbar erklären und eine Transaktion verweigern oder ihren nationalen Schuldendienst dergestalt umstrukturieren, dass es sich auf den Transfer von Geld in und aus diesem Land auswirkt. Im Fall einer Transferbeschränkung muss der Anteilshandel in einem Fonds bis zur Aufhebung der Transferbeschränkung möglicherweise ausgesetzt werden, und/oder der betreffende Fonds kann letztlich Gelder verlieren, wenn er die Erlöse aus dem Verkauf einer Transaktion nicht erfolgreich zurückführen kann.

Es ist zwar davon auszugehen, dass nur begrenzte Möglichkeiten zur Steuerung dieses Risikos zur Verfügung stehen, aber gemäß den OGAW-Vorschriften der Zentralbank investiert die Gesellschaft nur in Wertpapiere, die an Wertpapierbörsen gehandelt werden, die reguliert und anerkannt sind, regelmäßig betrieben werden und für die Öffentlichkeit zugänglich sind.

##### Abwicklungsrisiko

Da jeder Fonds einen Finanzindex nachbilden oder replizieren soll, investiert jeder Fonds in Vermögenswerte (oder schließt Geschäfte mit derivativen Finanzinstrumenten ab), die ein Engagement im maßgeblichen Finanzindex (oder seinen Komponenten) bieten, das der Anlagestrategie des jeweiligen Fonds entspricht wie im fondsspezifischen Nachtrag zum Verkaufsprospekt der Gesellschaft angegeben.

Das Abwicklungsrisiko ist das Risiko, dass die Abwicklung einer Transaktion in einer einem Fonds zugrunde liegenden Anlage scheitert. Scheitert die Abwicklung, ist der Fonds möglicherweise nicht in der Lage, den Kauf oder Verkauf einer Anlage zeitnah oder zu einem annähernd dem Zielwert des Anlageverwalters (oder des jeweiligen Unteranlageverwalters) entsprechenden Preis abzuschließen und/oder dem betreffenden Fonds drohen Geldstrafen oder Verzögerungen durch eine zuständige Regierungs-, Regulierungs- oder sonstige Aufsichtsbehörde.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

##### 4. Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft (Fortsetzung)

#### Fondsrisiko (d. h. anlagebezogenes Risiko) (Fortsetzung)

##### Abwicklungsrisiko (Fortsetzung)

Das Abwicklungsrisiko wird vom Anlageverwalter (und dem jeweiligen Unteranlageverwalter) gesteuert. Offene Transaktionen werden durch Überprüfung der vom Verwalter erstellten Inkongruenzberichte überwacht, und auf vom Scheitern bedrohte Transaktionen wird durch Interaktion mit den Kontrahenten und gegebenenfalls durch die Anwendung der Börsenregeln zur verzögerten Abwicklung reagiert.

##### Anlageperformancerisiko

Das Anlageperformancerisiko ist das Risiko, dass die Performance des Fonds (d. h. die Entwicklung des NIW des Fonds im Zeitverlauf) nicht den angegebenen Anlagezielen und der Anlagestrategie des Fonds entspricht. Da alle Fonds der Gesellschaft einen Finanzindex nachbilden oder replizieren sollen, wird die Performance fortlaufend gemessen durch Bezugnahme auf die Nachbildungsabweichung zwischen der Wertentwicklung des Fonds und des entsprechenden Index, den er nachbildet oder repliziert (die „Tracking Difference“).

Der Verwalter misst die tägliche Tracking Difference eines jeden Fonds und meldet die Performance an den Anlageverwalter. Der Anlageverwalter misst ebenfalls die tägliche Tracking Difference eines jeden Fonds und kann das Anlageportfolio eines Fonds, soweit notwendig, anpassen, um die Tracking Difference zu steuern, wenn diese das Zielniveau überschreitet.

##### Marktrisiko

Das Marktrisiko ist das Risiko, dass der Marktwert eines Fondsportfolios aufgrund von Veränderungen der Marktfaktoren sinkt. Zu den Marktfaktoren zählen Änderungen von Credit Spreads, Zinsen, Aktienmärkten, Wechselkursen, Volatilität, Korrelation sowie externe Schocks.

Das Marktrisiko wird in Anmerkung 12 zum Jahresabschluss genauer erörtert.

#### Betriebliche Risiken (d. h. Geschäfts-/Unternehmensrisiko)

##### Systemrisiko

Das Systemrisiko entsteht aus der Abhängigkeit von Systemen, die von den Bevollmächtigten eingesetzt werden und für die Rentabilität des Geschäfts der Gesellschaft kritisch sind. Ein Systemrisiko kann aufgrund fehlerhafter, fehlender oder nicht angemessen gesicherter technischer Ressourcen/IT-Systeme entstehen, aber auch aus unzulänglichen Planungs- und Testverfahren für die Geschäftskontinuität, unzulänglichen Systemen, unzulänglicher Wartung, Überwachung und Sicherheit und Ausfällen externer Anbieter.

Um das Systemrisiko zu mindern, stellt die Verwaltungsgesellschaft sicher, dass alle Bevollmächtigten über eine belastbare und effektive Geschäftskontinuitätsplanung verfügen. Ferner erhält und prüft der Risikoüberwachungsausschuss monatlich Berichte von den Bevollmächtigten bezüglich der eingerichteten Systeme und Vorkehrungen zum Katastrophenmanagement, die jeder Bevollmächtigter etabliert hat.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

##### 4. Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft (Fortsetzung)

#### Betriebliche Risiken (d. h. Geschäfts-/Unternehmensrisiko) (Fortsetzung)

##### Börsenhandelsrisiko

Das Börsenhandelsrisiko ist das Risiko, dass keine Marktmacher zur Verfügung stehen, um effektive Zwei-Wege-Preise (d. h. „Geld-Brief-Spannen“) für die Anteile eines Fonds an Börsen innerhalb der von der jeweiligen Börse vorgeschriebenen Limits zu liefern. Unter diesen Umständen kann die Möglichkeit für Anleger eingeschränkt sein, Anteile eines Fonds auf dem Sekundärmarkt zu kaufen und zu verkaufen, und die Gesellschaft kann von den jeweiligen Börsen mit Geldstrafen belegt werden.

Um dieses Risiko zu verringern, überwacht der Anlageverwalter die Geld-Brief-Spannen für jeden Fonds auf Intra-day-Basis und beauftragt gegebenenfalls Marktmacher, um dafür zu sorgen, dass die Sekundärmarktliquidität im jeweiligen Fonds in angemessenen Grenzen bleibt. Bezüglich der einzelnen an einer Börse notierten Anteilklassen eines Fonds schließt die Verwaltungsgesellschaft einen Vertrag mit einem offiziellen Liquiditätsgeber, der vertraglich verpflichtet ist, vorbehaltlich der Regelungen der jeweiligen maßgeblichen Börse die Geld-Brief-Spanne in bestimmten vereinbarten Limits zu halten.

Auf dem Sekundärmarkt erworbene Anteile können gewöhnlich nur von autorisierten Teilnehmern direkt an die Gesellschaft zurückverkauft werden. Gewöhnliche Anleger müssen solche Anteile mit Hilfe eines Intermediärs (z. B. eines Wertpapiermaklers) am Sekundärmarkt kaufen und verkaufen. Weicht der Börsenwert der Anteile eines Fonds allerdings stark von ihrem NIW ab, etwa, wenn (i) auf einer maßgeblichen Börse keine Marktmacher Geld-/Briefkurse stellen; oder (ii) wenn die notierten Geld-/Briefspannen an einer maßgeblichen Börse beständig die von dieser maßgeblichen Börse festgelegten Limits übersteigen, dürfen Anteilinhaber (d. h. Anleger in der betroffenen Anteilklasse, die bezüglich dieser Anteilklasse im Anteilinhaberregister der Gesellschaft erscheinen), die ihre Anteile auf dem Sekundärmarkt erworben haben, ihre Bestände gemäß den Bedingungen des Verkaufsprospekts der Gesellschaft direkt an die Gesellschaft zurückgeben.

##### Prozessrisiko

Das Prozessrisiko ist das Risiko, dass bisherige Prozesse und Verfahren unzulänglich oder ungeeignet sind, um das Geschäft effektiv zu führen.

Das Prozessrisiko wird vom Anlageverwalter gesteuert, der auch die von den einzelnen Unteranlageverwaltern eingesetzten Prozesse überwacht. Um das Prozessrisiko zu verringern, ist eine Reihe von Prozessen automatisiert, einschließlich des täglichen Handelsgeschäfts, der Sicherheitenberechnungen und der Abstimmungen zwischen dem Verwalter und den Kontrahenten.

##### Reputationsrisiko

Das Reputationsrisiko ist das Risiko, dass die Reputation der Verwaltungsgesellschaft geschädigt wird, was zu negativer Publicity, teuren Prozessen, einem Rückgang des Anlegerstamms eines oder mehrerer Fonds oder zum Ausscheiden wichtiger Mitarbeiter führen kann und dadurch unmittelbar oder mittelbar zum Rückgang in der Größe eines oder mehrerer Fonds führt, was letztendlich dazu führen könnte, dass diese Fonds geschlossen werden müssen.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

##### 4. Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft (Fortsetzung)

#### Betriebliche Risiken (d. h. Geschäfts-/Unternehmensrisiko) (Fortsetzung)

##### Reputationsrisiko (Fortsetzung)

Das Reputationsrisiko könnte unter anderem infolge von Handelsfehlern, einem Verstoß gegen maßgebliche Gesetze, Vorschriften oder die geltende Anlagepolitik, Preisfehlern und aufsichtsrechtlichen Sanktionen entstehen.

Das Reputationsrisiko wird von der Verwaltungsgesellschaft gesteuert, die dafür sorgt, dass Richtlinien und Verfahren eingerichtet werden, um die aufsichtsrechtliche Compliance sicherzustellen und das Fehlerpotenzial zu begrenzen. Die Verwaltungsgesellschaft überwacht Verstöße und Fehler fortlaufend, um sicherzustellen, dass alle Ausnahmesituationen zeitnah geklärt werden.

##### Produktisiko

Das Produktisiko ist das Ertragsrisiko durch nachteilige geschäftliche Entscheidungen, unsachgemäße Umsetzung von Entscheidungen oder mangelnde Reaktionsfähigkeit auf Veränderungen in der Branche, was dazu führen kann, dass Fonds mit nachlassender Anlegernachfrage letztendlich geschlossen werden müssen.

Das Produktisiko wird von der Verwaltungsgesellschaft gesteuert. Die Rentabilität der Fonds wird der Verwaltungsgesellschaft auf Quartalsbasis gemeldet, damit die Performance der einzelnen Fonds angemessen bewertet werden und sichergestellt werden kann, dass die vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft getroffenen geschäftlichen Entscheidungen angemessen sind.

##### Betrugsrisiko

Das Betrugsrisiko ist das Risiko eines Verlustes für einen Fonds oder die Gesellschaft infolge unrechtmäßiger oder krimineller Täuschungshandlungen durch Beschäftigte der Bevollmächtigten.

Das Betrugsrisiko wird von der Verwaltungsgesellschaft gesteuert und durch die Entgegennahme von Berichten der Compliance-Funktion der Bevollmächtigten gemindert, die auf monatlicher Basis an den Risikoüberwachungsausschuss und auf Quartalsbasis an den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft berichten.

##### Rechtliches / aufsichtsrechtliches Risiko

Das rechtliche Risiko umfasst insbesondere das Risiko eines Verstoßes gegen geltendes Recht und/oder geltende Vorschriften, der einen abträglichen Effekt auf den Geschäftsbetrieb haben könnte, die allgemeinen Vertragsrisiken sowie Prozesse und Prozesse gegen Beschäftigte von Bevollmächtigten.

Rechtliche Risiken werden von der Verwaltungsgesellschaft gesteuert und durch Delegation an LGIMH gemindert. LGIMH beschäftigt mehrere eigene Anwälte, die der Gesellschaft aufsichtsrechtliche Beratung und Unterstützung bei der Umsetzung sowie allgemeine Rechtsberatungsdienste bieten (die „Rechtsabteilung“). Der Verwaltungsgesellschaft steht in Irland und in den verschiedenen Ländern, in denen die Anteile von Fonds der Gesellschaft für den öffentlichen Vertrieb registriert und/oder zum Handel an einer maßgeblichen Börse zugelassen sind, ein ganzes Spektrum externer Rechtsberater zur Verfügung, um die laufende Konformität mit allen einschlägigen Gesetzen und Vorschriften sicherzustellen.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

##### 4. Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft (Fortsetzung)

#### Betriebliche Risiken (d. h. Geschäfts-/Unternehmensrisiko) (Fortsetzung)

##### Rechtliches / aufsichtsrechtliches Risiko (Fortsetzung)

Das aufsichtsrechtliche Risiko ist das Risiko, dass die Tätigkeit der Gesellschaft gegen geltende Gesetze und Vorschriften verstößt, die die Tätigkeit der Gesellschaft bezüglich ihres Geschäfts als Organismus für gemeinsame Anlagen regeln, insbesondere der Companies Act 2014, die OGAW-Vorschriften, die OGAW-Vorschriften der Zentralbank, die lokalen Regelungen zur grenzüberschreitenden Vermarktung der Fonds in den einzelnen ausländischen Hoheitsgebieten und die Regelungen der einzelnen Börsen, an denen die Fondsanteile gehandelt werden.

Um das aufsichtsrechtliche Risiko zu steuern, hält die Verwaltungsgesellschaft in Absprache mit dem Rechtsberater im jeweils maßgeblichen Hoheitsgebiet und den einzelnen einschlägigen Börsen eine Compliance-Matrix für die Zulassungs- und Notierungsvorschriften im Ausland vor.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält von der Rechtsabteilung und der Abteilung für Produktentwicklung Quartalsberichte über laufende Projekte, Analysen zu den Folgen der aufsichtsrechtlichen Aspekte und ihrer Umsetzung sowie allgemeine Rechts- und Vertragsangelegenheiten.

##### Compliance-Risiko

Das Compliance-Risiko ist das Risiko, dass keine angemessenen Richtlinien und Verfahren festgelegt, umgesetzt und aufrechterhalten werden können, die hinlänglich sicherstellen, dass die Gesellschaft, die Verwaltungsgesellschaft und die Bevollmächtigten die rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Verpflichtungen der Gesellschaft erfüllen.

Das Compliance-Risiko wird von der Verwaltungsgesellschaft gesteuert, und dessen Überwachung wird an die Compliance-Abteilung der Vertriebsstelle delegiert (die „Compliance-Abteilung“). Die Compliance-Abteilung hat die wesentlichen Einzelheiten zu den aufsichtsrechtlichen Systemen und Kontrollen der Gesellschaft in einem ausführlichen Compliance-Handbuch dokumentiert.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält von der Compliance-Abteilung Quartalsberichte über die Ergebnisse der Compliance-Überwachung und neue oder entstehende Compliance-Risiken.

##### Finanzberichterstattungsrisiko

Das Finanzberichterstattungsrisiko umfasst das Risiko, dass unzulängliche Geschäftsbücher geführt werden, das Risiko, dass der Abschluss kein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild von den Vermögenswerten, Verbindlichkeiten und der Finanz- und Ertragslage der Gesellschaft vermittelt und das Risiko, dass der Abschluss nicht den anwendbaren Bilanzierungsgrundsätzen (EU-IFRS), dem Companies Act 2014, den OGAW-Vorschriften und den OGAW-Vorschriften der Zentralbank entspricht.

Das Finanzberichterstattungsrisiko wird von der Gesellschaft gesteuert und durch Dienstgütevereinbarungen und geltender Leistungskennzahlen für Bevollmächtigte bezüglich delegierter Rechnungsfunktionen, monatlicher Überwachung der Bevollmächtigten und der regelmäßigen Überprüfung des Kontrollumfelds bei den Bevollmächtigten gemindert.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

##### 4. Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft (Fortsetzung)

#### Betriebliche Risiken (d. h. Geschäfts-/Unternehmensrisiko) (Fortsetzung)

##### Finanzberichterstattungsrisiko (Fortsetzung)

Die Gesellschaft hat Strukturen und Verfahren zur Sicherstellung eingeführt, dass alle maßgeblichen Geschäftsbücher und Aufzeichnungen ordnungsgemäß geführt werden und jederzeit verfügbar sind, einschließlich der Erstellung des geprüften Jahresabschlusses und des Halbjahresabschlusses. Insbesondere wurde der Verwalter bestellt, um die Geschäftsbücher und Unterlagen der Gesellschaft unabhängig vom Anlageverwalter und der Verwahrstelle zu führen, und ein aus zwei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern bestehender Prüfungsausschuss überwacht den Finanzberichterstattungsprozess sowie die diesbezüglichen internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme der Gesellschaft. Der geprüfte Jahresabschluss und der Halbjahresabschluss der Gesellschaft müssen vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigt und bei der Zentralbank und verschiedenen ausländischen Regulierungsbehörden und Börsen eingereicht werden. Der Jahresabschluss wurde gemäß den EU-IFRS, dem Companies Act 2014, den OGAW-Vorschriften und den OGAW-Vorschriften der Zentralbank aufgestellt. Der Jahresabschluss im Jahresbericht muss geprüft sein. Der Bericht der Abschlussprüfer, einschließlich etwaiger Einschränkungen, wird im Jahresbericht der Gesellschaft vollständig wiedergegeben.

##### 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.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle (Fortsetzung)

##### 4. Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft (Fortsetzung)

###### Überprüfung der Wirksamkeit

Der Verwaltungsrat hat die Effektivität der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme (einschließlich finanzieller, betrieblicher und Compliance-bezogener Kontrollen) im Einklang mit Ziffer 25 des britischen Corporate Governance Code von 2018 im Berichtsjahr und bis zum Datum der Genehmigung des Jahresabschlusses geprüft. Dem Verwaltungsrat sind keine maßgeblichen Mängel oder Schwachpunkte der internen Kontrollen bekannt, die sich im Zuge dieser Prüfung ergeben hätten. Hätten solche Mängel oder Schwachpunkte bestanden, so bestätigt der Verwaltungsrat, dass notwendige Gegenmaßnahmen ergriffen worden wären.

#### E. 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.

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 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 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](mailto:fundsales@lgim.com)) und Telefonnummer (+44 34 5070 8684) 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 Vertriebsstelle bestellt, die mit dem aktiven Management der Beziehungen zwischen der Gesellschaft und Anlegern betraut ist. Die 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 Vertriebsstelle nimmt an jeder vierteljährlichen Sitzung des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft teil, um in Bezug auf aktuelle Anlegerbeziehungen zu berichten.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### E. Anteilinhaber-Beziehungen (Fortsetzung)

##### 1. Anteilinhaberversammlungen

Die Einberufung und Durchführung von Versammlungen der Anteilinhaber 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 Anteilinhabern 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.

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.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### E. Anteilinhaber-Beziehungen (Fortsetzung)

##### 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 17 bis 18 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.

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.

#### Wirtschaftlichkeitserklärung

Ziffer 31 des britischen Corporate Governance Code von 2018 enthält eine Auflage für Unternehmen, eine an die Anteilinhaber gerichtete „Wirtschaftlichkeitserklärung“ mit der Absicht aufzunehmen, eine bessere und umfassendere Beurteilung der langfristigen Zahlungsfähigkeit und Liquidität zu liefern. Der UK-Code bietet keine Definition für „langfristig“, geht aber von einem über 12 Monate hinausgehenden Zeitraum aus, und davon, dass die einzelnen Unternehmen einen für den Charakter ihres eigenen Geschäfts angemessenen Zeitraum wählen.

Der Verwaltungsrat hat die Aussichten der Gesellschaft für den Zeitraum bis zur Jahreshauptversammlung („JHV“) 2023 bewertet. Der Verwaltungsrat hält zwei Jahre für einen angemessenen Zeitraum, über den die Aussichten der Gesellschaft bewertet werden können, da er nicht mit Änderungen im Ziel der Gesellschaft oder anderen Ereignissen rechnet, welche die Gesellschaft daran hindern, in dem genannten Zeitraum ihre Geschäftstätigkeit weiterzuführen. Des Weiteren geht der Verwaltungsrat nicht davon aus, dass die derzeit wichtigsten Risiken der Gesellschaft und die Angemessenheit der risikomindernden Kontrollen während dieses Zeitraums wesentlichen Änderungen unterworfen sein werden. Ein über zwei Jahre hinausgehender Zeitraum ist mit einem Ausmaß zukünftiger Unsicherheiten verbunden, für das eine Wirtschaftlichkeitserklärung nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht sinnvoll abgegeben werden kann.

Vor 2020 bewertete der Verwaltungsrat die Aussichten der Gesellschaft für einen Dreijahreszeitraum; aufgrund der COVID-19-Pandemie und der damit verbundenen Marktunsicherheit hat der Verwaltungsrat jedoch beschlossen, dass ein Zweijahreszeitraum angemessener ist. Diese Einschätzung gilt für die diesjährige Beurteilung der Wirtschaftlichkeit auch weiterhin.

Bei der Beurteilung der langfristigen Zahlungsfähigkeit und Liquidität hat der Verwaltungsrat die folgenden Faktoren berücksichtigt:

- Die wichtigsten Risiken und Ungewissheiten der Gesellschaft, die ausführlich im Abschnitt 4 „Bewertung der wichtigsten Risiken für die Gesellschaft“ in der Corporate-Governance-Erklärung beschrieben sind;
- die fortgesetzte Relevanz des Ziels der Gesellschaft im aktuellen Umfeld und
- die Höhe der Anlegernachfrage nach den von der Gesellschaft angebotenen Fonds.

Der Verwaltungsrat hat auch mehrere Finanzkennzahlen bei seiner Beurteilung berücksichtigt, unter anderem die Höhe der laufenden Erträge, Kosten und Kapitaltransaktionen sowie den Tracking Error und die Tracking Difference der einzelnen Fonds.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Wirtschaftlichkeitserklärung (Fortsetzung)

Ferner hat der Verwaltungsrat die Tatsache berücksichtigt, dass die Anlagen der Gesellschaft den von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank festgelegten Liquiditätsanforderungen entsprechen müssen. Dementsprechend hat sich der Verwaltungsrat vergewissert, dass die Gesellschaft in der Lage wäre, diese Anlagen gemäß Vorschrift 104 der OGAW-Vorschriften und vorbehaltlich der Bedingungen des Verkaufsprospekts der Gesellschaft zu veräußern, um Rücknahmeanträge von Anlegern zu erfüllen.

Auf der Grundlage seiner Einschätzungen und der Prozesse der Gesellschaft zur Überwachung der wichtigsten Risiken und Ungewissheiten der Gesellschaft und der Reaktionen darauf geht der Verwaltungsrat davon aus, dass die berechnete Erwartung besteht, dass die Gesellschaft über den Zeitraum bis zur JHV 2023 ihren Betrieb fortführt und ihre Verbindlichkeiten bei Fälligkeit begleicht.

### Ergebnisse und Dividenden

Die Ergebnisse des Geschäftsjahres sind in der Gesamtergebnisrechnung auf den Seiten 79 bis 85 aufgeführt.

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 wurden die folgenden Ausschüttungen von den nachstehend aufgeführten jeweiligen Fonds (oder ihren Anteilklassen) gezahlt:

Fonds	Anteilklasse	ISIN	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BHZKHS06	2.363.865 \$	1.895.304 \$
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	GBP Distributing ETF	IE00BLRPQN90	487.125 £	n. zutr.
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	GBP Distributing ETF	IE00BLRPQM83	1.231.800 £	n. zutr.
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BLRPQP15	1.250.238 \$	n. zutr.
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BLRPQL76	9.829.705 \$	n. zutr.
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF	EUR Hedged Distributing ETF	IE000F472DU7	686.243 €	n. zutr.
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BLRPRD67	1.582.280 \$	n. zutr.
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BLRPRF81	8.320.226 \$	n. zutr.
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	GBP Hedged Distributing ETF	IE000YPT5PG3	528 £	n. zutr.
L&G ESG Green Bond UCITS ETF	EUR Distributing ETF	IE00BMYDMD58	72.145 €	n. zutr.
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF	GBP Distributing ETF	IE00BMYDM802	2.267.426 £	229.840 £
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	EUR Distributing ETF	IE00BMYDM919	1.046.931 €	228.424 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BMYDMB35	945.390 \$	108.490 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BMYDMC42	481.220 \$	n. zutr.
L&G India INR Government Bond UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BL6K6H97	936.540 \$	n. zutr.

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 wurden keine weiteren Dividenden aus den anderen Fonds gezahlt.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Erklärung zur Fortführung der Gesellschaft

Nach der Bewertung der wichtigsten Risiken und der sonstigen im Zusammenhang mit der vorstehenden Erklärung zur Rentabilität erläuterten Sachverhalte erachtet es der Verwaltungsrat als angemessen, von einer Fortführung der Gesellschaft auszugehen und den Abschluss der Gesellschaft auf dieser Grundlage zu erstellen.

### Überblick über Geschäftsentwicklung und -ergebnis

Ein Bericht über das Geschäft ist in den Abschnitten „Informationen über die Gesellschaft“ auf den Seiten 4 bis 9 und „Fondsbericht“ auf den Seiten 10 bis 12 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 2022 und zum 30. Juni 2021 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 Anteilinhaber 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

#### Brexit und damit verbundene Risiken

Das Vereinigte Königreich (UK) trat am 31. Januar 2020 offiziell aus der Europäischen Union (EU) aus, unterlag aber während eines vereinbarten Übergangszeitraums bis zum 31. Dezember 2020 weiterhin EU-Vorschriften. Obgleich zwischen der EU und dem Vereinigten Königreich im Dezember 2020 ein Freihandelsabkommen abgeschlossen wurde und der Übergangszeitraum am 31. Dezember 2020 endete, waren Finanzdienstleistungen im Wesentlichen nicht Gegenstand dieses Freihandelsabkommens. Am 1. Januar 2021 trat eine Vereinbarung zwischen der britischen Financial Conduct Authority und der Europäischen Wertpapieraufsichtsbehörde (ESMA) (im Namen der zuständigen Nationalen Behörden der Europäischen Union) in Kraft, die die fortgesetzte Übertragung von Anlageverwaltungsdiensten zwischen der EU und dem Vereinigten Königreich ermöglicht. Für die Gesellschaft ist dies insoweit von Bedeutung, da ein britisches Unternehmen, namentlich Legal & General Investment Management Limited, mit dem Portfoliomanagement beauftragt wurde. Etwaige erforderlichen Änderungen an der Verwaltung und Beaufsichtigung der Gesellschaft und jegliche damit verbundene Übertragung von Zuständigkeiten wurden vor dem 31. Dezember 2020 vorgenommen.

Der Verwaltungsrat überwacht weiterhin alle künftigen Änderungen in den regulatorischen Beziehungen zwischen dem Vereinigten Königreich und der EU und alle potenziellen wirtschaftlichen Auswirkungen auf die Fonds der Gesellschaft auf kontinuierlicher Basis.

#### COVID-19

Seit März 2020 sind die globalen Finanzmärkte von der COVID-19-Pandemie betroffen. Während es in der Weltwirtschaft und den Märkten zu einer starken Verunsicherung kam und Unternehmen sowie das Alltagsleben erheblichen Störungen ausgesetzt waren, hat der Erfolg der Impfprogramme rund um den Globus für eine Stabilisierung der Märkte und eine Rückkehr zu einer gewissen Normalität gesorgt. Angesichts der Lockerung der pandemiebedingten Beschränkungen in den großen Volkswirtschaften gehen wir von einem Anstieg der Infektionsraten und der Möglichkeit aus, dass die Beschränkungen und Volatilität zurückkehren werden. Die Dauer der COVID-19-Pandemie und ihre Auswirkungen lassen sich nicht mit Sicherheit vorhersehen.

Der Verwaltungsrat überwacht weiterhin die künftigen Entwicklungen in der COVID-19-Pandemie sowie alle potenziellen wirtschaftlichen Auswirkungen auf die Fonds der Gesellschaft auf kontinuierlicher Basis.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

#### Osteuropa

Am 24. Februar 2022 startete Russlands 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 prozentuale Auswirkung auf das Nettovermögen des Fonds infolge der Anwendung der Richtlinien zur Zeitwertbewertung ist in Anmerkung 12.4 angegeben.

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.

Am 2. Juli 2021 wurde der L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF aufgelegt.

Am 8. Juli 2021 wurde der L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF an der London Stock Exchange („LSE“) gelistet.

Am 12. Juli 2021 wurde der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF aufgelegt.

Am 15. Juli 2021 wurde der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF an der LSE gelistet. Zum selben Termin wurden der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF und der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF auch an der Borsa Italiana und der Deutschen Börse gelistet.

Am 15. Juli 2021 wurden die abgesicherte thesaurierende EUR-Anteilklasse und die abgesicherte thesaurierende CHF-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF zugelassen und zum Vertrieb in Irland, im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, den Niederlanden, Italien, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und Spanien registriert. Die Anteilklassen wurden am 24. August 2021 in der Schweiz registriert und gelistet.

Am 22. Juli 2021 wurde die abgesicherte ausschüttende EUR-Anteilklasse des L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF an der LSE gelistet. Die Anteilklasse ist im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, den Niederlanden, Italien, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und Spanien zum Vertrieb zugelassen.

Am 23. September 2021 wurde der L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF auch an der Deutschen Börse und der Borsa Italiana gelistet.

Am 1. Oktober 2021 wurde die TER für die abgesicherten Anteilklassen des EM Corporate Bond für einen Zeitraum von drei Monaten bis zum 4. Januar 2022 auf 0,19 % gesenkt und danach wieder auf 0,38 % angehoben.

Am 26. Oktober 2021 wurde der L&G India INR Government Bond UCITS ETF aufgelegt.

Der L&G India INR Government Bond UCITS ETF wurde am 28. Oktober 2021 sowohl an der LSE als auch an der Borsa Italiana und an der Deutschen Börse gelistet.

Am 1. November 2021 wurde GO ETF Solutions LLP durch Legal & General Investment Management Limited als Anlageverwalter der Aktien- und synthetischen Fonds der Legal & General UCITS ETF plc ersetzt. Legal & General Investment Management Limited war zuvor nur als Anlageverwalter für die in festverzinslichen Wertpapieren investierten Fonds ernannt worden.

Am 17. November 2021 wurden der L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF, der der L&G Digital Payments UCITS ETF, der L&G India INR Government Bond UCITS ETF und der L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF in der Schweiz registriert und gelistet.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Am 29. November 2021 wurde die abgesicherte ausschüttende GBP-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF zugelassen und an der LSE gelistet.

Am 3. Dezember 2021 erfolgte an den eingetragenen Anteilhaber des L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF, The Bank of New York (Depository) Nominees Limited, eine Mitteilung, um ihn über die Schließung des Fonds zu unterrichten. Die Anleger in dem Fonds waren am 14. Januar 2022 Gegenstand einer Zwangsrücknahme.

Die Fonds haben keine „Vorzugsnotierung“ und haben stattdessen am 4. Januar 2022 auf eine „Standardnotierung“ gewechselt.

Am 18. Februar 2022 wurde die abgesicherte ausschüttende CHF-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF zugelassen, in der Schweiz registriert sowie am 24. März 2022 an der Swiss SIX Exchange gelistet.

Am 23. Februar 2022 wurde der Hauptverkaufsprospekt der Gesellschaft aktualisiert, um die Ernennung der Legal & General Investment Management Limited zum Anlageverwalter für alle Teilfonds der Gesellschaft sowie die Nachhaltigkeitspolitik zu berücksichtigen und klarzustellen, dass Prozesskosten von der Gesellschaft aus dem Vermögen der einzelnen Fonds gezahlt werden, und um die Abschnitte „Nachhaltigkeitsrisiken“ und „Risiko der Anlage in Chinas Interbank Bond Market über Bond Connect“ im Risikoabschnitt aufzunehmen. Anderen Absätzen mit zeitlichen Aktualisierungen wurde ebenfalls Rechnung getragen.

Am 6. April 2022 wurde die abgesicherte thesaurierende EUR-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF zugelassen, in Deutschland, Italien, Österreich und der Schweiz registriert sowie am 11. Mai 2022 an der Borsa Italiana und der Deutschen Börse gelistet.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse im Geschäftsjahr, die eine Auswirkung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 haben.

### Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres

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

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

Am 7. September 2022 wurden die folgenden Fonds aufgelegt und 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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Am 29. September 2022 genehmigte der Verwaltungsrat auf seiner Sitzung die Nicht-Anwendung des UK Code. Die Einhaltung des britischen Code ist nach dem am 4. Januar 2022 erfolgten Wechsel der Gesellschaft in das Standardsegment am Hauptmarkt der LSE keine regulatorische Anforderung mehr.

#### Finanzmärkte im Vereinigten Königreich

Angesichts der jüngsten Ereignisse an den Finanzmärkten im Vereinigten Königreich beobachtet der Verwaltungsrat Entwicklungen und alle potenziellen Liquiditäts- und Volatilitätsrisiken, die sich auf die Fonds der Gesellschaft auswirken könnten, genau. Der Verwaltungsrat hält es für unwahrscheinlich, dass diese Entwicklungen wesentliche direkte Auswirkungen auf die Fonds der Gesellschaft haben werden.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres, die eine Auswirkung auf den Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 haben.

#### 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

Datum: 26. Oktober 2022

---

Donard McClean

Verwaltungsratsmitglied

## Bericht des Prüfungsausschusses

Im März 2014 richtete die Gesellschaft einen Prüfungsausschuss ein, der sich aus den zwei unabhängigen, nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern Eimear Cowhey und Adrian Waters zusammensetzt (zusammen der „Prüfungsausschuss“). Am 31. März 2021 legten beide Verwaltungsratsmitglieder ihre Ämter im Verwaltungsrat und im Prüfungsausschuss der Legal & General UCITS ETF Plc nieder. Ihre Ämter im Prüfungsausschuss übernahmen mit Wirkung zum 31. März 2021 David Fagan und Donard McClean.

Herr Fagan ist Vorsitzender des Prüfungsausschusses.

Jedes Mitglied des Prüfungsausschusses ist mit den maßgeblichen Bestimmungen im UK-Code, im IF-Code, in den DTR-Regeln, in der Satzung der Gesellschaft, in den OGAW-Vorschriften der Zentralbank und im Companies Act 2014 sowie mit dem Geschäft, den Tätigkeiten der Gesellschaft und den damit verbundenen Risiken gründlich vertraut.

Der Verwaltungsrat hat die Mitglieder des Prüfungsausschusses überprüft und ist überzeugt, dass die Mitglieder über die entsprechende Erfahrung, Fachkompetenz und das Urteilsvermögen verfügen und ferner genügend Zeit haben, um die ihnen vom Verwaltungsrat übertragenen Befugnisse auszuüben. Der Verwaltungsrat hat deshalb beschlossen, dass es nicht erforderlich ist, ein drittes unabhängiges nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied für den Prüfungsausschuss zu bestellen.

### Zusammenfassung der im Berichtsjahr abgehaltenen Sitzungen des Prüfungsausschusses:

Am 16. Oktober 2021 fand eine Sitzung zu folgendem Zweck statt:

- Überprüfung des Prüfungsberichts (Audit Findings Report) des Abschlussprüfers sowie der Wirksamkeit des Prüfungsprozesses;
- Überprüfung und Genehmigung der Vollständigkeitserklärung der Gesellschaft an die Abschlussprüfer und der entsprechenden Erklärungen (Letters of Comfort) von verbundenen Parteien;
- Überprüfung und Genehmigung des Jahresabschlusses der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum Juni 2021 und
- Prüfung aktueller Informationen der Innenrevisionsfunktion der Muttergesellschaft im Zusammenhang mit der Durchführung des Innenrevisionsplans 2021;

An der Sitzung nahmen David Fagan und Donard McClean teil (die beiden Mitglieder des Prüfungsausschusses), vier Vertreter von Ernst & Young, Mitglieder des Innenrevisionsteams der Muttergesellschaft (Legal & General Investment Management (Holdings) Limited) sowie weitere Vertreter aus dem operativen und dem Finanzbereich der Muttergesellschaft.

Am 18. Februar 2022 fand eine zweite Sitzung zu folgendem Zweck statt:

- Prüfung aktueller Informationen der Innenrevisionsfunktion der Muttergesellschaft im Zusammenhang mit dem Innenrevisionsplan 2022;
- Prüfung und Genehmigung des Entwurfs des ungeprüften Halbjahresberichts und -abschlusses für das Geschäftshalbjahr zum 31. Dezember 2021;

## Bericht des Prüfungsausschusses (Fortsetzung)

### Zusammenfassung der im Berichtsjahr abgehaltenen Sitzungen des Prüfungsausschusses (Fortsetzung):

- Prüfung der Richtlinien der Gesellschaft in Bezug auf vom gesetzlichen Abschlussprüfer erbrachte prüfungsfremde Leistungen sowie eine Überprüfung der tatsächlichen Ausgaben 2021 im Vergleich zum Budget und das Budget für 2022.
- Überprüfung der Geschäftsordnung und des Kalenders des Prüfungsausschusses und
- Überprüfung der Effektivität und der Mitglieder des Prüfungsausschusses.

Am 19. Mai 2022 fand eine dritte Sitzung zu folgendem Zweck statt:

- Prüfung der internen finanziellen Kontroll- und Risikomanagementsysteme;
- Prüfung der Verfahren zur Vermeidung und Aufdeckung von Betrug, einschließlich Vorkehrungen für „Whistleblowing“;
- Überprüfung des Budgets für prüfungsfremde Leistungen und der zugrunde liegenden Richtlinien;
- Prüfung der Rechnungslegungsgrundsätze;
- Prüfung und Genehmigung des Prüfungsplans für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022;
- Prüfung der Bilanzierungsgrundsätze und -praktiken und Identifizierung und Berücksichtigung wesentlicher Finanzberichterstattungsrisiken und Beurteilungen;
- Überprüfung der Vergütung und der Konditionen für die Beauftragung des neuen externen Abschlussprüfers.
- Prüfung und Genehmigung des Außenrevisionsplans und
- Erwägung einer Überprüfung durch die Innenrevisionsfunktion der Muttergesellschaft.

An der Sitzung nahmen Herr Fagan und Herr McClean teil (die beiden Mitglieder des Prüfungsausschusses) und auf deren Einladung ein Mitglied des Financial Crime Teams der Muttergesellschaft, Mitglieder der Innenrevisionsfunktion der Muttergesellschaft, Vertreter aus dem operativen und dem Finanzbereich der Muttergesellschaft sowie Mitglieder der externen Abschlussprüfer, Ernst & Young.

### Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Innenrevision

Der Prüfungsausschuss hat beschlossen, dass es nicht erforderlich ist, dass die Gesellschaft ihre eigene Innenrevisionsfunktion hat, da das Management und die Verwaltung der Gesellschaft an die Verwaltungsgesellschaft, den Anlageverwalter, die Vertriebsstelle und den Verwalter delegiert wurden. Insbesondere der Innenrevisor des Anlageverwalters liefert dem Prüfungsausschuss regelmäßig Berichte und nimmt auf Einladung des Prüfungsausschusses an Sitzungen des Prüfungsausschusses teil.

### Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Bestellung der Abschlussprüfer

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 hat Ernst & Young (EY) keine prüfungsfremden Leistungen für die Gesellschaft erbracht. Der Prüfungsausschuss hat sich vergewissert, dass ausreichende Sicherheitsvorkehrungen getroffen wurden, um die Objektivität und Unabhängigkeit des Abschlussprüfers zu schützen.

Ernst & Young wurde 2020 erstmals als unabhängiger Abschlussprüfer bestellt.

## Bericht des Prüfungsausschusses (Fortsetzung)

Zusammenfassung der im Berichtszeitraum abgehaltenen Sitzungen des Prüfungsausschusses (Fortsetzung):

### Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Bestellung der Abschlussprüfer (Fortsetzung)

Der Prüfungsausschuss hat die Effektivität und Objektivität der Prüfungshandlungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 sowie die Effektivität, Leistung und Unabhängigkeit von EY beurteilt und ist zu dem Schluss gekommen, dass EY ihren Pflichten gegenüber Anteilhabern als unabhängiger Abschlussprüfer der Gesellschaft nachgekommen ist.

Der Prüfungsausschuss hat eine Richtlinie für prüfungsfremde Dienstleistungen eingeführt, die verbotene prüfungsfremde Dienstleistungen darlegt, die zu einer tatsächlichen oder vermeintlichen Gefahr für die Unabhängigkeit des Abschlussprüfers führen könnten. Vom für die Finanzkontrolle zuständigen Verwaltungsratsmitglied aus dem Verwaltungsrat der Gesellschaft ist die vorherige Zustimmung erforderlich, bevor der Abschlussprüfer mit der Erbringung anderer prüfungsfremder Leistungen beauftragt werden kann, die nicht auf der Liste verbotener Leistungen stehen.

Ferner berücksichtigt der Prüfungsausschuss die Bestimmungen des UK-Code und sonstige Anforderungen hinsichtlich der Corporate Governance im Kontext des Jahresabschlusses und Jahresberichts für das Geschäftsjahr.

Weitere Informationen finden Sie in der Corporate-Governance-Erklärung im Bericht des Verwaltungsrats auf den Seiten 19 bis 43.

### Wesentliche, in Bezug auf den Jahresabschluss erwogene Punkte

Der Prüfungsausschuss hat die Angemessenheit der Bilanzierungsgrundsätze der Gesellschaft geprüft und kam bei der Besprechung der Abschlussprüfung mit den Abschlussprüfern über Punkte überein, die diese als wesentlich für den Jahresabschluss erachteten.

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 waren es die folgenden Angelegenheiten, die ggf. nach Absprache mit den Abschlussprüfern dem speziellen Fokus des Prüfungsausschusses unterlagen:

#### Bewertung von Anlagen

Die Anlagen enthalten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sowie umgekehrte Pensionsgeschäfte. Die Bewertung von Anlagen gilt als wesentliche Angelegenheit und wird vom Anlageverwalter, vom Verwalter, von der Verwahrstelle, vom Prüfungsausschuss und vom Verwaltungsrat überwacht. Der Prüfungsausschuss erhält und prüft regelmäßige Berichte im Zusammenhang mit den Verfahren zur Bewertung von Vermögenswerten. Der Prüfungsausschuss kann basierend auf seiner Prüfung der Berichte Änderungen vorschlagen oder empfehlen, u. a. in Bezug auf die Angemessenheit der entsprechenden Angaben im Jahresabschluss.

Die Verantwortung für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft wurde an die Verwaltungsgesellschaft delegiert, die wiederum die Verantwortung auf den Verwalter übertragen hat.

Der Verwalter berichtet der Verwaltungsgesellschaft regelmäßig auf den monatlichen Sitzungen der Bevollmächtigten über alle Angelegenheiten, einschließlich der Bewertung von Anlagen. Der Verwaltungsrat überprüft regelmäßig die Mechanismen, die die Verwaltungsgesellschaft eingerichtet hat, um die delegierten Aufgaben der Bewertung und Abstimmung zu überwachen, die im Allgemeinen vom Verwalter ausgeübt werden und spezieller die Kontrollen, die zur Überwachung der Bewertung von Vermögenswerten und der Abstimmung von Vermögenswerten etabliert wurden.

In Fällen, in denen Bewertungen nicht möglich oder praktikabel sind oder nicht als repräsentativ für den „beizulegenden Zeitwert“ oder „wahrscheinlichen Realisationswert“ einer Anlage gelten, kommen alternative Bewertungen zum Einsatz. Demzufolge hat der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft beschlossen, den Anlageverwalter als die „kompetente Person“ für die Bewertung dieser Anlagen, bei Bedarf mit Unterstützung der Unteranlageverwalter, beauftragt.

## Bericht des Prüfungsausschusses (Fortsetzung)

### Besitz von Anlagen

Der Besitz von Anlagen gilt als wesentliche Angelegenheit und wird vom Anlageverwalter, vom Verwalter, von der Verwahrstelle, vom Prüfungsausschuss und vom Verwaltungsrat überwacht. Der Prüfungsausschuss erhält und prüft Berichte über den Besitz von Anlagen.

Die Verantwortung für die Überwachung des Besitzes von Anlagen wurde an die Verwahrstelle delegiert. Die Aufgaben der Verwahrstelle sind in der Corporate-Governance-Erklärung auf Seite 33 und im Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber auf Seite 53 enthalten.

Die Verwahrstelle berichtet der Verwaltungsgesellschaft regelmäßig, einschließlich bzgl. des Besitzes von Anlagen. Der Verwaltungsrat überprüft regelmäßig die Mechanismen, die die Verwaltungsgesellschaft eingerichtet hat, um die Verwahrstelle zu überwachen, einschließlich der etablierten Kontrollen zur Überwachung des Besitzes von Anlagen. Eine Erklärung zur Berichterstattung der einzelnen Bevollmächtigten ist in der Corporate-Governance-Erklärung auf Seite 34 enthalten.

Zur Prüfung und Billigung des Prüfungsplans von EY durch den Prüfungsausschuss erfolgte am 19. Mai 2022 ein Treffen des Prüfungsausschusses mit EY, bei dem insbesondere der Prüfungsansatz in Bezug auf die Bewertung und den Besitz von Anlagen besprochen wurde. Nach dieser Besprechung war der Prüfungsausschuss überzeugt, dass die vorgenommenen Beurteilungen und angewandten Methoden umsichtig und angebracht waren, und dass die richtige bilanzielle Behandlung angewandt wurde. EY berichtet dem Prüfungsausschuss über ihre Beurteilung der Bewertungsmethoden und -verfahren der Gesellschaft, die im Geschäftsjahr angewandt wurden.

Für den Prüfungsausschuss

---

David Fagan, Vorsitzender des Prüfungsausschusses

---

Donard McClean

Datum: 26. Oktober 2022

## Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber vom 30. Juni 2022

Für den Berichtszeitraum vom 1. Juli 2021 bis zum 30. Juni 2022 (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: 26. Oktober 2022

# 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 2022 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 2022 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;
- 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 Fonds 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 Fonds, Bedingungen schaffen könnten, die das Management zur Einstellung des Betriebs der Fonds veranlassen könnten.

## 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)

- Überprüfung der im Jahresbericht enthaltenen Angaben der Gesellschaft zur Unternehmensfortführung, um zu bewerten, ob die Angaben angemessen sind und den Rechnungslegungsgrundsätzen entsprechen.
- Bezüglich der Berichterstattung der Gesellschaft, wie diese den UK Corporate Governance Code angewandt hat, haben wir nichts Wesentliches hinzuzufügen, und bezüglich der Erklärung des Verwaltungsrats im Jahresabschluss, ob dieser es für angemessen erachtet, bei der Erstellung des Abschlusses von der Fortführung des Unternehmens auszugehen, haben wir keine Anmerkungen.

#### 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>Eigentum an finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die außerhalb des Depotbankennetzes gehalten werden</p> <p>Unserer Ansicht nach ist das Eigentum an finanziellen Vermögenswerten mit einem beizulegenden Zeitwert von 1.653.411.130 US\$ (2021: 1.396.525.966 US\$) und von finanziellen Verbindlichkeiten mit einem beizulegenden Zeitwert von 120.439.005 US\$ (2021: 1.319.868 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>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 11.847.697.269 US\$ (2021: 12.919.559.790 US\$) und von finanziellen Verbindlichkeiten mit einem beizulegenden Zeitwert von 120.439.005 US\$ (2021: 1.319.868 US\$) ein wesentlicher Prüfungssachverhalt, da es sich um eine zentrale Komponente der Gesamtbilanz der Gesellschaft handelt.</p>	<p>Wir haben vom Verwalter (BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company) der Gesellschaft zum 30. Juni 2022 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"> <li>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.</li> <li>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.</li> </ul> <p>Wir haben die Aufstellung der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 30. Juni 2022 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"> <li>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.</li> </ul>	<p>Aus der Durchführung unserer Prüfungshandlungen haben wir keine Probleme hinsichtlich dieser wichtigen Prüfungssachverhalte festgestellt.</p> <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
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.	<ul style="list-style-type: none"> <li>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.</li> </ul>	

#### 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 (2021: 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 Toleranzwesentlichkeit bei 75 % unserer Gesamtwesentlichkeit fest (2021: 75 %). 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 (2021: 5 %).

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 in Einklang mit dem Jahresabschluss stehen; und
- der Bericht des Verwaltungsrats gemäß geltenden rechtlichen Anforderungen erstellt wird.

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 über Angaben zu Vergütungen und Transaktionen des Verwaltungsrats vorgeschriebenen Angaben zu Vergütungen und Transaktionen des Verwaltungsrats nicht erteilt hat. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

##### **Corporate-Governance-Erklärung**

Wir haben die Erklärung des Verwaltungsrats bezüglich der Unternehmensfortführung und der längerfristigen Wirtschaftlichkeit sowie denjenigen Teil der Corporate-Governance-Erklärung, der sich auf die freiwillige Einhaltung der Bestimmungen des UK Corporate Governance Code bezieht, geprüft.

Auf Grundlage unserer Prüfungshandlungen sind wir zu dem Schluss gekommen, dass jedes der folgenden Elemente der Corporate-Governance-Erklärung im Wesentlichen mit dem Abschluss und unseren im Prüfungsverlauf erlangten Erkenntnissen im Einklang steht.

- Erklärung des Verwaltungsrats bezüglich der Angemessenheit, von der Fortführung des Unternehmens auszugehen, sowie bezüglich identifizierter wesentlicher Unsicherheiten, auf Seite 45:
- Erklärung des Verwaltungsrats bezüglich seiner Beurteilung der Aussichten der Gesellschaft, bezüglich des Zeitraums, den diese Beurteilung abdeckt, und warum dieser Zeitraum angemessen ist, auf den Seiten 43-45:
- Erklärung des Verwaltungsrats, dass der Jahresabschluss fair, ausgewogen und verständlich ist, auf Seite 21:
- Bestätigung des Verwaltungsrats, dass er eine robuste Beurteilung der aufkommenden und wesentlichen Risiken vorgenommen hat, auf den Seiten 34-40:
- Der Abschnitt des Jahresberichts, der die Prüfung der Wirksamkeit des Risikomanagements und der internen Kontrollsysteme beschreibt, auf den Seiten 40 und 41: und
- Der Abschnitt, der die Arbeit des Prüfungsausschusses beschreibt, auf den Seiten 49-52.

##### *Jeweilige Obliegenheiten*

##### **Obliegenheiten des Verwaltungsrats in Bezug auf den Jahresabschluss**

Wie in der Erklärung über die Obliegenheiten des Verwaltungsrates auf den Seiten 17 und 18 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.

## 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)

##### *Obliegenheiten des Verwaltungsrats in Bezug auf den Jahresabschluss (Fortsetzung)*

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.

Die Ziele unserer Prüfung in Bezug auf Verstöße sind: Identifizierung und Beurteilung der Risiken wesentlicher beabsichtigter Falschangaben im Jahresabschluss; Einholung hinreichender Prüfungsnachweise in Bezug auf die beurteilten Risiken wesentlich beabsichtigter Falschangaben, indem wir angemessene Reaktionen darauf planen und durchführen; und angemessene Reaktionen auf Verstöße oder vermutete Verstöße, die während der Prüfung identifiziert wurden. 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 der irische 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);
- Wir haben nachvollzogen, wie die Gesellschaft 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 (Fortsetzung)**

##### **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](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 3. Dezember 2021 mit der Prüfung des Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 und nachfolgende Berichtszeiträume bestellt. Die ununterbrochene Mandatsdauer des Abschlussprüfers, einschließlich bereits erfolgter Verlängerungen und erneuter Bestellungen, beträgt 3 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: 26. Oktober 2022**

## Bilanz der Gesellschaft

	Anm.	Zum 30. Juni 2022 Insgesamt \$	Zum 30. Juni 2021 Insgesamt \$
<b>Vermögenswerte</b>			
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	38.205.264	57.108.588
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	54.963.227	2.450.601
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet			
- Wertpapiere	12	10.046.145.229	11.398.035.050
- Geldmarktinstrumente	12	148.140.910	124.998.774
- Derivative Finanzinstrumente	12	3.703.501	41.722.568
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	1.649.707.629	1.354.803.398
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		29.449.010	24.317.057
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		7.041.906	18.709.827
Sonstige Vermögenswerte		34.956.237	22.251.150
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>12.012.312.913</b>	<b>13.044.397.013</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>			
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet			
- Derivative Finanzinstrumente	12	(120.439.005)	(1.319.868)
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	(2.062.565)	(1.077.871)
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	(2.811.988)	(22.876.918)
Fällige gekaufte Wertpapiere		(33.391.841)	(33.794.319)
Fällige Kapitalbeteiligungen		(17.615.320)	(41.650.058)
Sonstige Verbindlichkeiten		(5.416.889)	(4.772.465)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(181.737.608)</b>	<b>(105.491.499)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>11.830.575.305</b>	<b>12.938.905.514</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

David Fagan  
Verwaltungsratsmitglied

Donard McClean  
Verwaltungsratsmitglied

Genehmigungsdatum: 26. Oktober 2022

## Gesamtergebnisrechnung der Gesellschaft

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 Insgesamt \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 Insgesamt \$
<b>Erträge</b>			
Zinserträge		9.548	9.305
Dividendenerträge		163.449.734	91.059.725
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		55.208.954	12.097.975
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		6.525.284	2.383.300
Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(2.560.696.494)	2.510.228.364
<b>Gesamt(aufwendungen)/ Einnahmen</b>		<b>(2.335.502.974)</b>	<b>2.615.778.669</b>
<b>Aufwendungen</b>			
Verwaltungsgebühren	8	(58.784.798)	(41.356.860)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(101.232)	(84.251)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(58.886.030)</b>	<b>(41.441.111)</b>
<b>Netto(aufwendungen)/-erträge</b>		<b>(2.394.389.004)</b>	<b>2.574.337.558</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>			
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	(33.055.831)	(2.601.575)
Zinsaufwand		(199.161)	(79.778)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		(428.525)	(504.744)
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(33.683.517)</b>	<b>(3.186.097)</b>
<b>(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>(2.428.072.521)</b>	<b>2.571.151.461</b>
Quellensteuern		(19.866.801)	(11.723.804)
<b>(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor dem sonstigen Gesamtergebnis</b>		<b>(2.447.939.322)</b>	<b>2.559.427.657</b>
<b>Sonstiges Gesamtergebnis</b>			
Umrechnungsdifferenzen		(104.591.000)	23.281.137
<b>(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(2.552.530.322)</b>	<b>2.582.708.794</b>

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 2022 Insgesamt \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 Insgesamt \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>12.938.905.514</b>	<b>4.877.173.558</b>
(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern		(2.552.530.322)	2.582.708.794
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	6.676.788.630	7.657.168.599
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(5.232.588.517)	(2.178.145.437)
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		1.444.200.113	5.479.023.162
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>11.830.575.305</b>	<b>12.938.905.514</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Kapitalflussrechnung der Gesellschaft

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 Insgesamt \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 Insgesamt \$
<b>Cashflows-Abfluss aus laufender Geschäftstätigkeit</b>			
(Verlust)/Gewinn nach Steuern		(2.447.939.322)	2.559.427.657
<b>Berichtigung aufgrund von:</b>			
Zinserträge		(61.743.786)	(14.490.580)
Zinsaufwand		627.686	584.522
Ausschüttung an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile		33.055.831	2.601.575
Dividendenerträge		(163.449.734)	(91.059.725)
Quellensteuern		19.866.801	11.723.804
		<b>(2.619.582.524)</b>	<b>2.468.787.253</b>
<b>(Zunahme)/Abnahme des Vermögens:</b>			
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten		(52.512.626)	6.710.425
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		1.066.328.090	(8.039.541.000)
Forderungen gegenüber Maklern		–	–
Sonstige Forderungen		(3.036.442)	(20.051)
<b>Zunahme/(Abnahme) der Verbindlichkeiten:</b>			
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten		(20.064.930)	16.360.517
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		119.119.137	(382.175)
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		(73)	1.525
Aufgelaufene Kosten		644.497	2.631.813
<b>Mittelabfluss aus der Geschäftstätigkeit.</b>		<b>(1.509.104.871)</b>	<b>(5.545.451.693)</b>
Vereinnahmte Zinsen		53.585.050	(1.752.187)
Zinsaufwand		(627.686)	(584.522)
Vereinnahmte Dividenden		142.073.024	75.024.563
<b>Nettomittelabfluss aus der Geschäftstätigkeit.</b>		<b>(1.314.074.483)</b>	<b>(5.472.763.839)</b>
<b>Mittelzufluss aus der Finanzierungstätigkeit</b>			
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile		(33.055.831)	(2.601.575)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen*	6	6.688.456.551	7.641.441.045
Rücknahmen rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile*	6	(5.256.623.255)	(2.165.255.717)
<b>Nettomittelzufluss aus der Finanzierungstätigkeit</b>		<b>1.398.777.465</b>	<b>5.473.583.753</b>
<b>Nettozunahme von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten</b>		<b>84.702.982</b>	<b>819.914</b>
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente am Anfang des Geschäftsjahres		56.030.717	31.929.666
Umrechnungsdifferenzen		(104.591.000)	23.281.137
<b>Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>36.142.699</b>	<b>56.030.717</b>

\* 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 2022

	Anm.	30. Juni 2022 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	30. Juni 2022 L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	30. Juni 2022 L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	30. Juni 2022 L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	30. Juni 2022 L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	332.507	–	1.360.795	–	–	–	173.911
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	1.140.000	–	28.330.000	–	470.000	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	31.667.664	–	–	–	–	–	33.728.032
- Geldmarktinstrumente	12	–	1.343.357	2.929.038	49.574.992	2.573.265	787.364	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	2.851.623	–	278.323	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	27.076.328	36.774.800	623.438.724	16.159.757	10.443.751	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	–	–	–	–	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	1.515.591	2.045.440	1.553.234	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		–	–	2.483	1.401	3.870	385	27.695
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>32.000.171</b>	<b>31.075.276</b>	<b>45.964.179</b>	<b>702.898.351</b>	<b>19.015.215</b>	<b>11.701.500</b>	<b>33.929.638</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	(2.098.885)	–	(44.009.038)	–	(202.833)	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	(783)	–	(78.231)	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	(1.470.000)	–	(1.050.000)	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	(950.000)	–	–	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(21.908)	(16.339)	(22.994)	(650.855)	(17.210)	(11.980)	(8.439)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(21.908)</b>	<b>(3.066.007)</b>	<b>(1.492.994)</b>	<b>(44.738.124)</b>	<b>(1.067.210)</b>	<b>(214.813)</b>	<b>(8.439)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>31.978.263</b>	<b>28.009.269</b>	<b>44.471.185</b>	<b>658.160.227</b>	<b>17.948.005</b>	<b>11.486.687</b>	<b>33.921.199</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

	Anm.	30. Juni 2022 L&G Gold Mining UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G ROBO Global@ Robotics and Automation UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Cyber Security UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G All Commodities UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF <sup>1</sup> \$	30. Juni 2022 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	396.231	–	227.825	4.928.566	383	–	1.471.619
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	90.620	–	–	3.770.000	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	126.762.821	–	801.566.570	2.467.615.921	–	–	772.386.992
- Geldmarktinstrumente	12	–	2.341.426	–	–	7.316.215	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	29.294.923	–	–	102.009.070	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	–	–	–	–	–	2.682.684
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		135.545	10.587	672.982	–	4.977	–	663.384
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>127.294.597</b>	<b>31.737.556</b>	<b>802.467.377</b>	<b>2.472.544.487</b>	<b>113.100.645</b>	–	<b>777.204.679</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	(869.132)	–	–	(6.923.757)	–	–
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)	(80.430)	–	(349.225)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(78.168)</b>	<b>(887.746)</b>	<b>(595.494)</b>	<b>(1.470.165)</b>	<b>(7.004.187)</b>	–	<b>(2.973.907)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>127.216.429</b>	<b>30.849.810</b>	<b>801.871.883</b>	<b>2.471.074.322</b>	<b>106.096.458</b>	–	<b>774.230.772</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde am 14. Januar 2022 geschlossen.  
Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

	Anm.	30. Juni 2022 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G US Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G UK Equity UCITS ETF £	30. Juni 2022 L&G Japan Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Global Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	44.318	1.180.750	261.521	55.758	1.386.704	87.261	198.035
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	33.895.308	262.471.950	385.283.834	45.112.420	280.471.821	55.893.321	194.700.839
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	–	–	–	991	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		31.371	1.034.970	247.866	77.000	336.343	52.322	80.722
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>33.970.997</b>	<b>264.687.670</b>	<b>385.793.221</b>	<b>45.245.178</b>	<b>282.195.859</b>	<b>56.032.904</b>	<b>194.979.596</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	–	–	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(13.505)	(112.326)	(15.769)	(1.344)	(22.811)	(4.761)	(12.489)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(13.505)</b>	<b>(112.326)</b>	<b>(15.769)</b>	<b>(1.344)</b>	<b>(22.811)</b>	<b>(4.761)</b>	<b>(12.489)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>33.957.492</b>	<b>264.575.344</b>	<b>385.777.452</b>	<b>45.243.834</b>	<b>282.173.048</b>	<b>56.028.143</b>	<b>194.967.107</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

	Anm.	30. Juni 2022 L&G Asia Pacific ex Japan Equity 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 Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF €	30. Juni 2022 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G Clean Energy UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	584.623	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	263.207.659	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		804.861	984.993	202.037	19.989	96.732	510.590	62.668
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>264.597.143</b>	<b>310.871.174</b>	<b>223.570.854</b>	<b>126.479.395</b>	<b>92.134.296</b>	<b>859.900.513</b>	<b>182.373.817</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	(14.874)	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		(707.804)	(1.657.384)	–	–	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	(1.192.582)	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(20.604)	(127.687)	(94.265)	(50.902)	(12.633)	(87.237)	(76.419)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(728.408)</b>	<b>(1.785.071)</b>	<b>(94.265)</b>	<b>(1.258.358)</b>	<b>(12.633)</b>	<b>(87.237)</b>	<b>(76.419)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>263.868.735</b>	<b>309.086.103</b>	<b>223.476.589</b>	<b>125.221.037</b>	<b>92.121.663</b>	<b>859.813.276</b>	<b>182.297.398</b>

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 ESG China CNY Bond UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF £	30. Juni 2022 L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF \$	30. Juni 2022 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	6.860	284.218	114.723	75.719	11.957	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	21.554.315	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	122.393	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	88.447	900.495	14.771.146
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>70.181.001</b>	<b>85.272.447</b>	<b>82.199.773</b>	<b>261.062.563</b>	<b>21.777.112</b>	<b>93.126.315</b>	<b>977.966.486</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
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)	(126.511)	(1.664.636)	(14.201.291)
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	(265.714)
Sonstige Verbindlichkeiten		(5.111)	(6.107)	(15.997)	(61.849)	(1.255)	(6.579)	(301.257)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(1.284.708)</b>	<b>(601.620)</b>	<b>(2.561.142)</b>	<b>(2.537.372)</b>	<b>(127.766)</b>	<b>(1.671.215)</b>	<b>(24.783.940)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>68.896.293</b>	<b>84.670.827</b>	<b>79.638.631</b>	<b>258.525.191</b>	<b>21.649.346</b>	<b>91.455.100</b>	<b>953.182.546</b>

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 UK 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 \$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	1.216.683	14.090.888	93.433	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	42.591.242	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	429.783	16.800	84.197	812
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>497.144.782</b>	<b>22.519.064</b>	<b>43.114.458</b>	<b>21.298.520</b>	<b>21.076.992</b>	<b>11.599.290</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
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)	(8.842)	(4.615)	(7.256)	(4.931)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(217.832)</b>	<b>(14.375.464)</b>	<b>(8.842)</b>	<b>(4.615)</b>	<b>(7.256)</b>	<b>(4.931)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>496.926.950</b>	<b>8.143.600</b>	<b>43.105.616</b>	<b>21.293.905</b>	<b>21.069.736</b>	<b>11.594.359</b>

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 <sup>1</sup> \$	30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>2</sup> \$	30. Juni 2022 L&G India INR Government Bond UCITS ETF <sup>3</sup> \$
<b>Vermögenswerte</b>				
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>897.347.892</b>	<b>15.862.488</b>	<b>284.911.090</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
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)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(58.585.308)</b>	<b>(6.111)</b>	<b>(5.543.919)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>838.762.584</b>	<b>15.856.377</b>	<b>279.367.171</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.<sup>2</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.<sup>3</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Bilanz

Zum 30. Juni 2021

	Anm.	30. Juni 2021 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	30. Juni 2021 L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	30. Juni 2021 L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	30. Juni 2021 L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	30. Juni 2021 L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	32.408.896	290.108	224	1.489.420	91	–	102.373
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	580.000	–	–	60.000	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	42.347.972	–	–	–	–	–	38.710.047
- Geldmarktinstrumente	12	–	1.813.614	2.805.266	103.571.225	1.823.332	598.160	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	366.869	37.901.189	–	53.803	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	24.266.328	44.148.270	1.103.956.000	17.820.000	10.588.751	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	–	–	–	–	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	1.857.377	–	1.225.632	–
Sonstige Vermögenswerte		–	–	3.357	47.859	167	100	23.813
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>74.756.868</b>	<b>26.370.050</b>	<b>47.903.986</b>	<b>1.248.823.070</b>	<b>19.643.590</b>	<b>12.526.446</b>	<b>38.836.233</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	(247.816)	–	–	(133.209)	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	(290.000)	–	(20.500.000)	(270.000)	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	–	(1.728.000)	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		(30.814.420)	–	–	(1.481.924)	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(53.114)	(12.919)	(23.295)	(356.066)	(14.140)	(6.370)	(9.520)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(30.867.534)</b>	<b>(550.735)</b>	<b>(23.295)</b>	<b>(24.065.990)</b>	<b>(417.349)</b>	<b>(6.370)</b>	<b>(9.520)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>43.889.334</b>	<b>25.819.315</b>	<b>47.880.691</b>	<b>1.224.757.080</b>	<b>19.226.241</b>	<b>12.520.076</b>	<b>38.826.713</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021

	Anm.	30. Juni 2021 L&G Gold Mining UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Cyber Security UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G All Commodities UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	320.046	–	2.212.912	5.246.345	–	–	1.430.002
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	1.679.894	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	155.213.214	–	1.252.893.177	2.788.358.945	–	–	832.509.597
- Geldmarktinstrumente	12	–	2.926.984	–	–	8.543.256	1.134.629	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	2.961.381	350.603	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	36.548.923	–	–	83.859.070	10.061.553	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	–	–	415.294	–	–	764.308
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	1.283.020	–	–	6.422.250
Sonstige Vermögenswerte		51.048	12	605.895	215.388	3.683	422	528.272
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>155.584.308</b>	<b>41.155.813</b>	<b>1.255.711.984</b>	<b>2.795.518.992</b>	<b>95.367.390</b>	<b>11.547.207</b>	<b>841.654.429</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	(841.962)	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	(2.731)	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	(1.500.000)	(160.017)	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	–	(1.698.124)	–	–	(7.167.345)
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(94.812)	(12.427)	(846.569)	(1.674.498)	(14.929)	(3.243)	(332.965)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(94.812)</b>	<b>(854.389)</b>	<b>(846.569)</b>	<b>(3.372.622)</b>	<b>(1.517.660)</b>	<b>(163.260)</b>	<b>(7.500.310)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>155.489.496</b>	<b>40.301.424</b>	<b>1.254.865.415</b>	<b>2.792.146.370</b>	<b>93.849.730</b>	<b>11.383.947</b>	<b>834.154.119</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021

	Anm.	30. Juni 2021 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G US Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G UK Equity UCITS ETF £	30. Juni 2021 L&G Japan Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Global Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	58.645	999.247	173.102	13.302	1.398.999	108.763	162.990
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	34.270.643	610.390.357	295.165.887	16.601.989	251.110.148	51.244.821	112.865.476
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	–	–	–	746	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	5.366.220	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		15.111	1.172.177	144.258	48.111	241.706	43.408	68.008
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>34.344.399</b>	<b>617.928.001</b>	<b>295.483.247</b>	<b>16.663.402</b>	<b>252.751.599</b>	<b>51.396.992</b>	<b>113.096.474</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	(5.365.911)	–	–	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(12.898)	(226.067)	(11.831)	(690)	(21.204)	(4.196)	(9.314)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(12.898)</b>	<b>(5.591.978)</b>	<b>(11.831)</b>	<b>(690)</b>	<b>(21.204)</b>	<b>(4.196)</b>	<b>(9.314)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>34.331.501</b>	<b>612.336.023</b>	<b>295.471.416</b>	<b>16.662.712</b>	<b>252.730.395</b>	<b>51.392.796</b>	<b>113.087.160</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021

	Anm.	30. Juni 2021 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Clean Water UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF €	30. Juni 2021 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Clean Energy UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	700.739	117.454	13.743	374.745	151.838	2.221.125	136.209
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	172.688.495	231.554.039	255.249.690	219.066.567	233.621.909	1.703.516.278	115.077.930
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		822	–	2.604.111	–	2.936	7.446.266	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		515.991	599.288	27.424	14.855	243.048	651.331	72.581
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>173.906.047</b>	<b>232.270.781</b>	<b>257.894.968</b>	<b>219.456.167</b>	<b>234.019.731</b>	<b>1.713.835.000</b>	<b>115.286.720</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	(263.711)	(25.191)	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	(1.900.964)	–	–	(7.452.750)	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(14.372)	(90.155)	(99.888)	(74.440)	(30.842)	(169.326)	(43.358)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(14.372)</b>	<b>(90.155)</b>	<b>(2.264.563)</b>	<b>(99.631)</b>	<b>(30.842)</b>	<b>(7.622.076)</b>	<b>(43.358)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>173.891.675</b>	<b>232.180.626</b>	<b>255.630.405</b>	<b>219.356.536</b>	<b>233.988.889</b>	<b>1.706.212.924</b>	<b>115.243.362</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021

	Anm.	30. Juni 2021 L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £	30. Juni 2021 L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	30. Juni 2021 L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF £	30. Juni 2021 L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	284.636	183.294	72.663	628.837	98.269	626.689	3.848.839
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	59.438.850	66.552.915	49.258.671	420.684.390	28.207.803	91.799.714	571.954.920
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		817.311	791.641	778.424	–	–	–	9.306.248
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		693.839	846.882	655.851	6.118.090	132.952	734.659	6.310.789
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>61.234.636</b>	<b>68.374.732</b>	<b>50.765.609</b>	<b>427.431.317</b>	<b>28.439.024</b>	<b>93.161.062</b>	<b>591.420.796</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		(1.091.900)	(972.376)	(853.230)	–	(81.625)	(397.973)	(11.166.455)
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(4.444)	(4.959)	(10.269)	(89.556)	(1.398)	(6.509)	(164.349)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(1.096.344)</b>	<b>(977.335)</b>	<b>(863.499)</b>	<b>(89.556)</b>	<b>(83.023)</b>	<b>(404.482)</b>	<b>(11.330.804)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>60.138.292</b>	<b>67.397.397</b>	<b>49.902.110</b>	<b>427.341.761</b>	<b>28.356.001</b>	<b>92.756.580</b>	<b>580.089.992</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021

	Anm.	30. Juni 2021 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G ESG Green Bond UCITS ETF €	30. Juni 2021 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF £	30. Juni 2021 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	30. Juni 2021 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	30. Juni 2021 L&G Digital Payments UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4	636.112	144.608	29.965	–	40.725	10.739
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Wertpapiere	12	459.443.397	22.984.312	26.267.797	16.171.246	19.686.569	6.265.782
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Wertpapieren		–	653.236	–	–	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		895.090	–	–	1.005.755	–	–
Sonstige Vermögenswerte		267.855	97.875	160.550	28.115	66.393	–
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>461.242.454</b>	<b>23.880.031</b>	<b>26.458.312</b>	<b>17.205.116</b>	<b>19.793.687</b>	<b>6.276.521</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	(906.606)	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		(1.340.067)	(694.713)	–	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(175.939)	(4.735)	(5.476)	(3.216)	(6.512)	(1.685)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(1.516.006)</b>	<b>(699.448)</b>	<b>(5.476)</b>	<b>(909.822)</b>	<b>(6.512)</b>	<b>(1.685)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>459.726.448</b>	<b>23.180.583</b>	<b>26.452.836</b>	<b>16.295.294</b>	<b>19.787.175</b>	<b>6.274.836</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		2.375	–	34	199	95	7	6
Dividendenerträge		641.387	–	–	–	–	–	529.220
Zinserträge aus Schultiteln und Geldmarktinstrumenten		–	567	–	75.909	2.205	2.418	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	3.672.857	47.587	39.413	–
Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(5.445.499)	(10.177.983)	13.485.192	224.491.316	2.405.206	(153.746)	(9.822.679)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>(4.801.737)</b>	<b>(10.177.416)</b>	<b>13.485.226</b>	<b>228.240.281</b>	<b>2.455.093</b>	<b>(111.908)</b>	<b>(9.293.453)</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(311.854)	(110.360)	(273.909)	(2.970.403)	(90.072)	(79.299)	(115.408)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–	(4.399)	(5.555)	(10.184)	(3.417)	(2.553)	(3.588)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(311.854)</b>	<b>(114.759)</b>	<b>(279.464)</b>	<b>(2.980.587)</b>	<b>(93.489)</b>	<b>(81.852)</b>	<b>(118.996)</b>
<b>Netto(aufwendungen)/-erträge</b>		<b>(5.113.591)</b>	<b>(10.292.175)</b>	<b>13.205.762</b>	<b>225.259.694</b>	<b>2.361.604</b>	<b>(193.760)</b>	<b>(9.412.449)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(240)	(4.857)	(6.340)	(9)	(155)	(628)	(124)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	(143.253)	(237.339)	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(240)</b>	<b>(148.110)</b>	<b>(243.679)</b>	<b>(9)</b>	<b>(155)</b>	<b>(628)</b>	<b>(124)</b>
<b>(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>(5.113.831)</b>	<b>(10.440.285)</b>	<b>12.962.083</b>	<b>225.259.685</b>	<b>2.361.449</b>	<b>(194.388)</b>	<b>(9.412.573)</b>
Quellensteuern		(64.290)	–	–	–	–	–	(71.422)
<b>(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(5.178.121)</b>	<b>(10.440.285)</b>	<b>12.962.083</b>	<b>225.259.685</b>	<b>2.361.449</b>	<b>(194.388)</b>	<b>(9.483.995)</b>

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 Gold Mining UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Cyber Security UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G All Commodities UCITS ETF \$	Für den Berichtszeitraum vom 1. Juli 2021 bis zum 14. Januar 2022 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		35	5	140	1.502	1	–	236
Dividendenerträge		3.486.295	–	10.308.387	44.961.006	–	–	14.459.184
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	4.155	–	–	20.296	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	88.938	–	–	486.516	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)	25.110.096	449.657	(233.074.225)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>(37.031.036)</b>	<b>(466.811)</b>	<b>(369.527.291)</b>	<b>(854.862.452)</b>	<b>25.616.909</b>	<b>452.889</b>	<b>(218.614.805)</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(1.039.314)	(85.661)	(9.332.229)	(20.492.375)	(172.312)	(4.591)	(4.435.315)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(1.522)	(5.384)	(4.487)	(2.061)	(6.631)	(944)	(1.436)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(1.040.836)</b>	<b>(91.045)</b>	<b>(9.336.716)</b>	<b>(20.494.436)</b>	<b>(178.943)</b>	<b>(5.535)</b>	<b>(4.436.751)</b>
<b>Netto(aufwendungen)/-erträge</b>		<b>(38.071.872)</b>	<b>(557.856)</b>	<b>(378.864.007)</b>	<b>(875.356.888)</b>	<b>25.437.966</b>	<b>447.354</b>	<b>(223.051.556)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	(2.363.865)	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(4.680)	(546)	(8.556)	(22.186)	(1)	(18)	(24.181)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(4.680)</b>	<b>(2.364.411)</b>	<b>(8.556)</b>	<b>(22.186)</b>	<b>(1)</b>	<b>(18)</b>	<b>(24.181)</b>
<b>(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>(38.076.552)</b>	<b>(2.922.267)</b>	<b>(378.872.563)</b>	<b>(875.379.074)</b>	<b>25.437.965</b>	<b>447.336</b>	<b>(223.075.737)</b>
Quellensteuern		(399.418)	–	(1.645.809)	(4.939.704)	–	–	(2.311.051)
<b>(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(38.475.970)</b>	<b>(2.922.267)</b>	<b>(380.518.372)</b>	<b>(880.318.778)</b>	<b>25.437.965</b>	<b>447.336</b>	<b>(225.386.788)</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde am 14. Januar 2022 geschlossen.  
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 \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G US Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G UK Equity UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Global Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		9	91	31	3	337	20	4
Dividendenerträge		299.232	16.378.394	4.660.609	751.401	5.734.355	1.160.190	3.545.810
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)	(54.211.309)	732.109	(56.758.105)	(10.555.064)	(14.824.010)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>(6.499.489)</b>	<b>(125.467.783)</b>	<b>(49.550.669)</b>	<b>1.483.513</b>	<b>(51.023.413)</b>	<b>(9.394.854)</b>	<b>(11.278.196)</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(170.252)	(2.450.383)	(162.609)	(9.979)	(250.503)	(59.257)	(120.010)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(590)	(1.630)	(1.216)	(350)	(835)	(1.602)	(2.176)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(170.842)</b>	<b>(2.452.013)</b>	<b>(163.825)</b>	<b>(10.329)</b>	<b>(251.338)</b>	<b>(60.859)</b>	<b>(122.186)</b>
<b>Netto(aufwendungen)/-erträge</b>		<b>(6.670.331)</b>	<b>(127.919.796)</b>	<b>(49.714.494)</b>	<b>1.473.184</b>	<b>(51.274.751)</b>	<b>(9.455.713)</b>	<b>(11.400.382)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(143)	(22.420)	(1.654)	(39)	(567)	(33)	(1.427)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(143)</b>	<b>(22.420)</b>	<b>(1.654)</b>	<b>(39)</b>	<b>(567)</b>	<b>(33)</b>	<b>(1.427)</b>
<b>(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>(6.670.474)</b>	<b>(127.942.216)</b>	<b>(49.716.148)</b>	<b>1.473.145</b>	<b>(51.275.318)</b>	<b>(9.455.746)</b>	<b>(11.401.809)</b>
Quellensteuern		(53.410)	(1.878.453)	(665.027)	(4.283)	(860.523)	(141.917)	(461.947)
<b>(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(6.723.884)</b>	<b>(129.820.669)</b>	<b>(50.381.175)</b>	<b>1.468.862</b>	<b>(52.135.841)</b>	<b>(9.597.663)</b>	<b>(11.863.756)</b>

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 Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$	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 Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Clean Energy UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		46	1.965	65	53	3	94	79
Dividenerträge		8.110.385	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	(44.829.176)	(75.181.838)	(128.361.312)	(89.238.378)	(6.716.798)	(170.699.143)	(45.489.231)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>(36.718.745)</b>	<b>(69.777.732)</b>	<b>(126.645.894)</b>	<b>(88.724.656)</b>	<b>(2.648.313)</b>	<b>(151.942.153)</b>	<b>(43.092.190)</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(221.409)	(1.560.248)	(1.426.343)	(920.501)	(261.987)	(1.824.403)	(703.402)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(2.900)	(1.075)	(1.505)	(1.877)	(2.556)	(3.319)	(2.820)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(224.309)</b>	<b>(1.561.323)</b>	<b>(1.427.848)</b>	<b>(922.378)</b>	<b>(264.543)</b>	<b>(1.827.722)</b>	<b>(706.222)</b>
<b>Nettoaufwendungen</b>		<b>(36.943.054)</b>	<b>(71.339.055)</b>	<b>(128.073.742)</b>	<b>(89.647.034)</b>	<b>(2.912.856)</b>	<b>(153.769.875)</b>	<b>(43.798.412)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(1.007)	(4.180)	(920)	(664)	(2.945)	(50)	(4.152)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(1.007)</b>	<b>(4.180)</b>	<b>(920)</b>	<b>(664)</b>	<b>(2.945)</b>	<b>(50)</b>	<b>(4.152)</b>
<b>Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>(36.944.061)</b>	<b>(71.343.235)</b>	<b>(128.074.662)</b>	<b>(89.647.698)</b>	<b>(2.915.801)</b>	<b>(153.769.925)</b>	<b>(43.802.564)</b>
Quellensteuern		(109.780)	(724.499)	(259.132)	(70.023)	(437.433)	(2.725.985)	(311.673)
<b>Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(37.053.841)</b>	<b>(72.067.734)</b>	<b>(128.333.794)</b>	<b>(89.717.721)</b>	<b>(3.353.234)</b>	<b>(156.495.910)</b>	<b>(44.114.237)</b>

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 ESG China CNY Bond UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF £	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 \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		1	–	30	1.078	–	6	425
Dividendenerträge		–	–	–	–	–	–	–
Zinserträge aus Schultiteln und Geldmarktinstrumenten		717.191	1.436.488	1.786.912	10.847.639	41.545	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)	(947.894)	(13.780.741)	(210.172.781)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>(3.651.075)</b>	<b>(11.462.528)</b>	<b>(8.896.637)</b>	<b>9.644.712</b>	<b>(906.349)</b>	<b>(11.858.954)</b>	<b>(180.779.860)</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(59.002)	(66.862)	(143.056)	(1.098.065)	(16.250)	(79.600)	(2.592.489)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–	–	–	–	–	–	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(59.002)</b>	<b>(66.862)</b>	<b>(143.056)</b>	<b>(1.098.065)</b>	<b>(16.250)</b>	<b>(79.600)</b>	<b>(2.592.489)</b>
<b>Netto(aufwendungen)/-erträge</b>		<b>(3.710.077)</b>	<b>(11.529.390)</b>	<b>(9.039.693)</b>	<b>8.546.647</b>	<b>(922.599)</b>	<b>(11.938.554)</b>	<b>(183.372.349)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	(487.125)	(1.231.800)	(1.250.238)	(10.616.191)	–	(1.582.280)	(8.320.951)
Zinsaufwand		(205)	(493)	(354)	(15.977)	(86)	(306)	(17.726)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(487.330)</b>	<b>(1.232.293)</b>	<b>(1.250.592)</b>	<b>(10.632.168)</b>	<b>(86)</b>	<b>(1.582.586)</b>	<b>(8.338.677)</b>
<b>Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>(4.197.407)</b>	<b>(12.761.683)</b>	<b>(10.290.285)</b>	<b>(2.085.521)</b>	<b>(922.685)</b>	<b>(13.521.140)</b>	<b>(191.711.026)</b>
Quellensteuern		808	(991)	(20.781)	–	–	(1.960)	(163.259)
<b>Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(4.196.599)</b>	<b>(12.762.674)</b>	<b>(10.311.066)</b>	<b>(2.085.521)</b>	<b>(922.685)</b>	<b>(13.523.100)</b>	<b>(191.874.285)</b>

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 Hydrogen Economy UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G ESG Green Bond UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Digital Payments UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>							
Zinserträge		409	1	5	—	6	4
Dividendenerträge		7.687.561	—	2.492.704	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)	(3.522.478)	(2.229.017)	(4.661.908)	(8.606.498)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>(260.320.952)</b>	<b>(3.232.583)</b>	<b>(1.029.769)</b>	<b>(1.014.186)</b>	<b>(3.551.026)</b>	<b>(8.538.223)</b>
<b>Aufwendungen</b>							
Verwaltungsgebühren	8	(2.574.290)	(56.872)	(88.210)	(51.941)	(87.208)	(64.655)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(1.764)	—	(435)	(2.046)	(2.795)	(633)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(2.576.054)</b>	<b>(56.872)</b>	<b>(88.645)</b>	<b>(53.987)</b>	<b>(90.003)</b>	<b>(65.288)</b>
<b>Nettoaufwendungen</b>		<b>(262.897.006)</b>	<b>(3.289.455)</b>	<b>(1.118.414)</b>	<b>(1.068.173)</b>	<b>(3.641.029)</b>	<b>(8.603.511)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>							
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	—	(72.145)	(2.267.426)	(1.046.931)	(945.390)	—
Zinsaufwand		(21.977)	(124)	(90)	(273)	(86)	(186)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		—	—	—	—	—	—
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(21.977)</b>	<b>(72.269)</b>	<b>(2.267.516)</b>	<b>(1.047.204)</b>	<b>(945.476)</b>	<b>(186)</b>
<b>Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>(262.918.983)</b>	<b>(3.361.724)</b>	<b>(3.385.930)</b>	<b>(2.115.377)</b>	<b>(4.586.505)</b>	<b>(8.603.697)</b>
Quellensteuern		(1.019.335)	881	(15.354)	(176.892)	(85.614)	(7.007)
<b>Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(263.938.318)</b>	<b>(3.360.843)</b>	<b>(3.401.284)</b>	<b>(2.292.269)</b>	<b>(4.672.119)</b>	<b>(8.610.704)</b>

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 <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>2</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G India INR Government Bond UCITS ETF <sup>3</sup> \$
<b>Erträge</b>				
Zinserträge		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)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>185.345.650</b>	<b>(2.256.413)</b>	<b>(20.850.881)</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Verwaltungsgebühren	8	(1.349.663)	(70.512)	(486.612)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(6.092)	(6.523)	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(1.355.755)</b>	<b>(77.035)</b>	<b>(486.612)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>183.989.895</b>	<b>(2.333.448)</b>	<b>(21.337.493)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>				
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	(481.220)	(936.540)
Zinsaufwand		(17.400)	(2.480)	(6.106)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(17.400)</b>	<b>(483.700)</b>	<b>(942.646)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>183.972.495</b>	<b>(2.817.148)</b>	<b>(22.280.139)</b>
Quellensteuern		–	(99.555)	–
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>183.972.495</b>	<b>(2.916.703)</b>	<b>(22.280.139)</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>2</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>3</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		2.103	–	–	53	116	23	8
Dividendenerträge		721.492	–	–	–	–	–	167.848
Zinserträge aus Schultiteln und Geldmarktinstrumenten		–	5.081	(11.460)	19.685	(45)	281	1.285
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	1.917.282	7.155	8.081	31.213
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	9.500.319	13.611.460	(29.322.823)	306.371.839	6.047.814	(4.316.239)	16.096.327
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>10.223.914</b>	<b>13.616.541</b>	<b>(29.334.283)</b>	<b>308.308.859</b>	<b>6.055.040</b>	<b>(4.307.854)</b>	<b>16.296.681</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(342.397)	(111.103)	(327.823)	(2.419.582)	(83.667)	(100.926)	(132.843)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–	(4.211)	(4.366)	(8.295)	(3.305)	(3.071)	(6.405)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(342.397)</b>	<b>(115.314)</b>	<b>(332.189)</b>	<b>(2.427.877)</b>	<b>(86.972)</b>	<b>(103.997)</b>	<b>(139.248)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>9.881.517</b>	<b>13.501.227</b>	<b>(29.666.472)</b>	<b>305.880.982</b>	<b>5.968.068</b>	<b>(4.411.851)</b>	<b>16.157.433</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(216)	(3.054)	(6.928)	(373)	(123)	(319)	(160)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	(140.143)	(283.176)	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(216)</b>	<b>(143.197)</b>	<b>(290.104)</b>	<b>(373)</b>	<b>(123)</b>	<b>(319)</b>	<b>(160)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>9.881.301</b>	<b>13.358.030</b>	<b>(29.956.576)</b>	<b>305.880.609</b>	<b>5.967.945</b>	<b>(4.412.170)</b>	<b>16.157.273</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(72.684)	–	–	–	–	–	(24.287)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>9.808.617</b>	<b>13.358.030</b>	<b>(29.956.576)</b>	<b>305.880.609</b>	<b>5.967.945</b>	<b>(4.412.170)</b>	<b>16.132.986</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Gold Mining UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Cyber Security UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		1.504	5	3.634	441	10	–	90
Dividendenerträge		2.184.847	–	10.284.288	16.393.249	–	–	7.026.899
Zinserträge aus Schultiteln und Geldmarktinstrumenten		11.381	598	–	–	(812)	333	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		204.196	23.536	–	–	163.427	23.150	–
Nettogewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	1.819.857	13.606.953	432.283.302	612.460.749	24.667.091	3.333.012	213.160.734
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>4.221.785</b>	<b>13.631.092</b>	<b>442.571.224</b>	<b>628.854.439</b>	<b>24.829.716</b>	<b>3.356.495</b>	<b>220.187.723</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(1.285.006)	(50.679)	(9.158.054)	(16.442.306)	(100.445)	(29.187)	(2.308.610)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(4.634)	(4.328)	(4.644)	(2.312)	(4.789)	(1.810)	(995)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(1.289.640)</b>	<b>(55.007)</b>	<b>(9.162.698)</b>	<b>(16.444.618)</b>	<b>(105.234)</b>	<b>(30.997)</b>	<b>(2.309.605)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>2.932.145</b>	<b>13.576.085</b>	<b>433.408.526</b>	<b>612.409.821</b>	<b>24.724.482</b>	<b>3.325.498</b>	<b>217.878.118</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	(1.895.304)	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(3.331)	(178)	(7.439)	(14.129)	(24)	–	(5.317)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(3.331)</b>	<b>(1.895.482)</b>	<b>(7.439)</b>	<b>(14.129)</b>	<b>(24)</b>	<b>–</b>	<b>(5.317)</b>
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>2.928.814</b>	<b>11.680.603</b>	<b>433.401.087</b>	<b>612.395.692</b>	<b>24.724.458</b>	<b>3.325.498</b>	<b>217.872.801</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(272.820)	–	(1.584.239)	(1.548.783)	–	–	(961.432)
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>2.655.994</b>	<b>11.680.603</b>	<b>431.816.848</b>	<b>610.846.909</b>	<b>24.724.458</b>	<b>3.325.498</b>	<b>216.911.369</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G US Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G UK Equity UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Global Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		5	48	15	1	7	6	489
Dividendenerträge		235.696	6.691.073	3.475.271	532.749	5.007.875	804.988	2.675.784
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	–	–	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	2.977.922	146.532.077	76.210.554	1.831.481	37.204.404	12.425.364	28.930.720
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>3.213.623</b>	<b>153.223.198</b>	<b>79.685.840</b>	<b>2.364.231</b>	<b>42.212.286</b>	<b>13.230.358</b>	<b>31.606.993</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(137.288)	(1.656.178)	(116.172)	(6.712)	(222.558)	(41.102)	(117.144)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(485)	(1.260)	(1.464)	(429)	(1.570)	(2.489)	(2.799)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(137.773)</b>	<b>(1.657.438)</b>	<b>(117.636)</b>	<b>(7.141)</b>	<b>(224.128)</b>	<b>(43.591)</b>	<b>(119.943)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>3.075.850</b>	<b>151.565.760</b>	<b>79.568.204</b>	<b>2.357.090</b>	<b>41.988.158</b>	<b>13.186.767</b>	<b>31.487.050</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(795)	(8.171)	(237)	(44)	(652)	(35)	(4.484)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(795)</b>	<b>(8.171)</b>	<b>(237)</b>	<b>(44)</b>	<b>(652)</b>	<b>(35)</b>	<b>(4.484)</b>
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>3.075.055</b>	<b>151.557.589</b>	<b>79.567.967</b>	<b>2.357.046</b>	<b>41.987.506</b>	<b>13.186.732</b>	<b>31.482.566</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(40.391)	(1.129.630)	(486.087)	(3.466)	(753.333)	(97.245)	(373.265)
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>3.034.664</b>	<b>150.427.959</b>	<b>79.081.880</b>	<b>2.353.580</b>	<b>41.234.173</b>	<b>13.089.487</b>	<b>31.109.301</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Clean Water UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Clean Energy UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		15	12	36	38	8	74	8
Dividenerträge		3.467.935	1.532.090	645.128	419.396	4.592.636	18.307.383	732.778
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	–	–	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	23.909.677	25.923.389	61.185.703	28.270.062	34.959.622	430.235.358	(3.758.300)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>27.377.627</b>	<b>27.455.491</b>	<b>61.830.867</b>	<b>28.689.496</b>	<b>39.552.266</b>	<b>448.542.815</b>	<b>(3.025.514)</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(112.783)	(377.368)	(905.631)	(569.041)	(233.616)	(1.672.520)	(171.100)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(2.094)	(610)	(1.351)	(1.715)	(3.197)	(4.596)	(670)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(114.877)</b>	<b>(377.978)</b>	<b>(906.982)</b>	<b>(570.756)</b>	<b>(236.813)</b>	<b>(1.677.116)</b>	<b>(171.770)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>27.262.750</b>	<b>27.077.513</b>	<b>60.923.885</b>	<b>28.118.740</b>	<b>39.315.453</b>	<b>446.865.699</b>	<b>(3.197.284)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(774)	(1.492)	(592)	(1.030)	(1.894)	(24)	(876)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(774)</b>	<b>(1.492)</b>	<b>(592)</b>	<b>(1.030)</b>	<b>(1.894)</b>	<b>(24)</b>	<b>(876)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>27.261.976</b>	<b>27.076.021</b>	<b>60.923.293</b>	<b>28.117.710</b>	<b>39.313.559</b>	<b>446.865.675</b>	<b>(3.198.160)</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(72.256)	(172.843)	(93.101)	(71.264)	(497.150)	(2.588.393)	(108.482)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>27.189.720</b>	<b>26.903.178</b>	<b>60.830.192</b>	<b>28.046.446</b>	<b>38.816.409</b>	<b>444.277.282</b>	<b>(3.306.642)</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		–	–	4	6	–	1	119
Dividendenerträge		–	–	–	–	–	–	–
Zinserträge aus Schultiteln und Geldmarktinstrumenten		223.777	554.254	654.367	3.013.567	(4.715)	459.539	6.818.700
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(97.264)	(1.251.619)	209.306	2.959.446	(147.855)	386.358	(1.920.051)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>126.513</b>	<b>(697.365)</b>	<b>863.677</b>	<b>5.973.019</b>	<b>(152.570)</b>	<b>845.898</b>	<b>4.898.768</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(27.699)	(30.647)	(64.793)	(303.436)	(9.203)	(22.295)	(746.877)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–	–	–	–	–	–	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(27.699)</b>	<b>(30.647)</b>	<b>(64.793)</b>	<b>(303.436)</b>	<b>(9.203)</b>	<b>(22.295)</b>	<b>(746.877)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>98.814</b>	<b>(728.012)</b>	<b>798.884</b>	<b>5.669.583</b>	<b>(161.773)</b>	<b>823.603</b>	<b>4.151.891</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(88)	(4)	(76)	(1.275)	(1)	(7)	(64)
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(88)</b>	<b>(4)</b>	<b>(76)</b>	<b>(1.275)</b>	<b>(1)</b>	<b>(7)</b>	<b>(64)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>98.726</b>	<b>(728.016)</b>	<b>798.808</b>	<b>5.668.308</b>	<b>(161.774)</b>	<b>823.596</b>	<b>4.151.827</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(14.864)	(3.927)	(22.437)	–	–	(5.446)	(181.720)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>83.862</b>	<b>(731.943)</b>	<b>776.371</b>	<b>5.668.308</b>	<b>(161.774)</b>	<b>818.150</b>	<b>3.970.107</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Hydrogen Economy UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG Green Bond UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Digital Payments UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>							
Zinserträge		21	2	–	–	257	1
Dividendenerträge		2.609.680	–	270.310	342.987	172.812	3.008
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	48.216	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–
Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(26.494.440)	(336.893)	204.515	(67.336)	601.787	98.615
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>(23.884.739)</b>	<b>(288.675)</b>	<b>474.825</b>	<b>275.651</b>	<b>774.856</b>	<b>101.624</b>
<b>Aufwendungen</b>							
Verwaltungsgebühren	8	(604.582)	(21.888)	(12.981)	(8.056)	(15.678)	(1.849)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(1.015)	–	(128)	(8)	–	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(605.597)</b>	<b>(21.888)</b>	<b>(13.109)</b>	<b>(8.064)</b>	<b>(15.678)</b>	<b>(1.849)</b>
<b>Netto(aufwendungen)/-erträge</b>		<b>(24.490.336)</b>	<b>(310.563)</b>	<b>461.716</b>	<b>267.587</b>	<b>759.178</b>	<b>99.775</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>							
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	(229.840)	(228.424)	(108.490)	–
Zinsaufwand		(11.703)	(19)	–	(192)	(264)	–
Zinsaufwand für umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	–	–	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(11.703)</b>	<b>(19)</b>	<b>(229.840)</b>	<b>(228.616)</b>	<b>(108.754)</b>	<b>–</b>
<b>(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>(24.502.039)</b>	<b>(310.582)</b>	<b>231.876</b>	<b>38.971</b>	<b>650.424</b>	<b>99.775</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(303.753)	(1.277)	–	(47.251)	(6.079)	(24)
<b>(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(24.805.792)</b>	<b>(311.859)</b>	<b>231.876</b>	<b>(8.280)</b>	<b>644.345</b>	<b>99.751</b>

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

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>43.889.334</b>	<b>25.819.315</b>	<b>47.880.691</b>	<b>1.224.757.080</b>	<b>19.226.241</b>	<b>12.520.076</b>	<b>38.826.713</b>
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(5.178.121)	(10.440.285)	12.962.083	225.259.685	2.361.449	(194.388)	(9.483.995)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	3.164.990	29.780.280	63.749.899	509.791.893	53.632.265	34.916.587	10.200.657
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(9.897.940)	(17.150.041)	(80.121.488)	(1.301.648.431)	(57.271.950)	(35.755.588)	(5.622.176)
Netto(abnahme)/-zunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		(6.732.950)	12.630.239	(16.371.589)	(791.856.538)	(3.639.685)	(839.001)	4.578.481
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>31.978.263</b>	<b>28.009.269</b>	<b>44.471.185</b>	<b>658.160.227</b>	<b>17.948.005</b>	<b>11.486.687</b>	<b>33.921.199</b>

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Gold Mining UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Cyber Security UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G All Commodities UCITS ETF \$	Für den Berichtszeitraum vom 1. Juli 2021 bis zum 14. Januar 2022  L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>155.489.496</b>	<b>40.301.424</b>	<b>1.254.865.415</b>	<b>2.792.146.370</b>	<b>93.849.730</b>	<b>11.383.947</b>	<b>834.154.119</b>
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(38.475.970)	(2.922.267)	(380.518.372)	(880.318.778)	25.437.965	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	72.252.412	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)	(85.443.649)	(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	(13.191.237)	(11.831.283)	165.463.441
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>127.216.429</b>	<b>30.849.810</b>	<b>801.871.883</b>	<b>2.471.074.322</b>	<b>106.096.458</b>	<b>-</b>	<b>774.230.772</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde am 14. Januar 2022 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 2022

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G US Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G UK Equity UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Global Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>34.331.501</b>	<b>612.336.023</b>	<b>295.471.416</b>	<b>16.662.712</b>	<b>252.730.395</b>	<b>51.392.796</b>	<b>113.087.160</b>
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(6.723.884)	(129.820.669)	(50.381.175)	1.468.862	(52.135.841)	(9.597.663)	(11.863.756)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	13.976.800	198.032.470	192.194.051	27.112.260	114.379.864	14.233.010	95.108.793
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(7.626.925)	(415.972.480)	(51.506.840)	–	(32.801.370)	–	(1.365.090)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		6.349.875	(217.940.010)	140.687.211	27.112.260	81.578.494	14.233.010	93.743.703
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>33.957.492</b>	<b>264.575.344</b>	<b>385.777.452</b>	<b>45.243.834</b>	<b>282.173.048</b>	<b>56.028.143</b>	<b>194.967.107</b>

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$	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 Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 L&G Clean Energy UCITS ETF \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>173.891.675</b>	<b>232.180.626</b>	<b>255.630.405</b>	<b>219.356.536</b>	<b>233.988.889</b>	<b>1.706.212.924</b>	<b>115.243.362</b>
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(37.053.841)	(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	135.202.851	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	(8.171.950)	(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		127.030.901	148.973.211	96.179.978	(4.417.778)	(138.513.992)	(689.903.738)	111.168.273
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>263.868.735</b>	<b>309.086.103</b>	<b>223.476.589</b>	<b>125.221.037</b>	<b>92.121.663</b>	<b>859.813.276</b>	<b>182.297.398</b>

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 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 ESG China CNY Bond UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF £	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 \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>60.138.292</b>	<b>67.397.397</b>	<b>49.902.110</b>	<b>427.341.761</b>	<b>28.356.001</b>	<b>92.756.580</b>	<b>580.089.992</b>
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(4.196.599)	(12.762.674)	(10.311.066)	(2.085.521)	(922.685)	(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	7.290.935	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)	(13.074.905)	(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)	(5.783.970)	12.221.620	564.966.839
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>68.896.293</b>	<b>84.670.827</b>	<b>79.638.631</b>	<b>258.525.191</b>	<b>21.649.346</b>	<b>91.455.100</b>	<b>953.182.546</b>

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Hydrogen Economy UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G ESG Green Bond UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Digital Payments UCITS ETF \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>459.726.448</b>	<b>23.180.583</b>	<b>26.452.836</b>	<b>16.295.294</b>	<b>19.787.175</b>	<b>6.274.836</b>
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(263.938.318)	(3.360.843)	(3.401.284)	(2.292.269)	(4.672.119)	(8.610.704)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	312.690.150	4.109.011	20.054.064	8.300.050	5.954.680	13.930.227
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(11.551.330)	(15.785.151)	–	(1.009.170)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		301.138.820	(11.676.140)	20.054.064	7.290.880	5.954.680	13.930.227
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>496.926.950</b>	<b>8.143.600</b>	<b>43.105.616</b>	<b>21.293.905</b>	<b>21.069.736</b>	<b>11.594.359</b>

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 Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>2</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022  L&G India INR Government Bond UCITS ETF <sup>3</sup> \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		–	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		183.972.495	(2.916.703)	(22.280.139)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	699.252.162	22.788.660	307.278.390
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(44.462.073)	(4.015.580)	(5.631.080)
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		654.790.089	18.773.080	301.647.310
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>838.762.584</b>	<b>15.856.377</b>	<b>279.367.171</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>2</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>3</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 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 2021

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>27.517.011</b>	<b>30.354.290</b>	<b>67.772.133</b>	<b>439.243.546</b>	<b>12.487.709</b>	<b>26.073.456</b>	<b>48.856.605</b>
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		9.808.617	13.358.030	(29.956.576)	305.880.609	5.967.945	(4.412.170)	16.132.986
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	44.768.833	19.526.274	48.724.025	898.403.739	41.485.991	11.942.371	5.359.310
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(38.205.127)	(37.419.279)	(38.658.891)	(418.770.814)	(40.715.404)	(21.083.581)	(31.522.188)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		6.563.706	(17.893.005)	10.065.134	479.632.925	770.587	(9.141.210)	(26.162.878)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>43.889.334</b>	<b>25.819.315</b>	<b>47.880.691</b>	<b>1.224.757.080</b>	<b>19.226.241</b>	<b>12.520.076</b>	<b>38.826.713</b>

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Gold Mining UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Cyber Security UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>273.800.641</b>	<b>13.578.782</b>	<b>816.606.435</b>	<b>1.547.753.663</b>	<b>50.460.470</b>	<b>7.801.655</b>	<b>111.264.445</b>
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		2.655.994	11.680.603	431.816.848	610.846.909	24.724.458	3.325.498	216.911.369
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	2.197.266	16.069.859	326.625.589	801.006.938	28.086.401	9.930.114	580.392.180
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(123.164.405)	(1.027.820)	(320.183.457)	(167.461.140)	(9.421.599)	(9.673.320)	(74.413.875)
Netto(abnahme)/-zunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		(120.967.139)	15.042.039	6.442.132	633.545.798	18.664.802	256.794	505.978.305
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>155.489.496</b>	<b>40.301.424</b>	<b>1.254.865.415</b>	<b>2.792.146.370</b>	<b>93.849.730</b>	<b>11.383.947</b>	<b>834.154.119</b>

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 2021

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G US Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G UK Equity UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Global Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>25.643.912</b>	<b>58.987.801</b>	<b>137.286.308</b>	<b>10.962.695</b>	<b>116.469.371</b>	<b>32.552.079</b>	<b>99.876.259</b>
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		3.034.664	150.427.959	79.081.880	2.353.580	41.234.173	13.089.487	31.109.301
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	24.448.485	461.037.558	80.721.728	3.346.437	129.701.076	5.751.230	31.657.200
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(18.795.560)	(58.117.295)	(1.618.500)	–	(34.674.225)	–	(49.555.600)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		5.652.925	402.920.263	79.103.228	3.346.437	95.026.851	5.751.230	(17.898.400)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>34.331.501</b>	<b>612.336.023</b>	<b>295.471.416</b>	<b>16.662.712</b>	<b>252.730.395</b>	<b>51.392.796</b>	<b>113.087.160</b>

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Clean Water UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 L&G Clean Energy UCITS ETF <sup>1</sup> \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>47.377.214</b>	<b>15.520.613</b>	<b>82.834.267</b>	<b>33.256.148</b>	<b>92.898.894</b>	<b>602.438.807</b>	–
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		27.189.720	26.903.178	60.830.192	28.046.446	38.816.409	444.277.282	(3.306.642)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	102.514.461	195.312.532	144.091.279	249.268.508	102.273.586	1.138.461.026	135.565.952
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(3.189.720)	(5.555.697)	(32.125.333)	(91.214.566)	–	(478.964.191)	(17.015.948)
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		99.324.741	189.756.835	111.965.946	158.053.942	102.273.586	659.496.835	118.550.004
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>173.891.675</b>	<b>232.180.626</b>	<b>255.630.405</b>	<b>219.356.536</b>	<b>233.988.889</b>	<b>1.706.212.924</b>	<b>115.243.362</b>

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 5. November 2020 aufgelegt.

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 2021

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF <sup>1</sup> £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF <sup>1</sup> £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF <sup>1</sup> £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF <sup>2</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF <sup>2</sup> \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		–	–	–	–	–	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		83.862	(731.943)	776.371	5.668.308	(161.774)	818.150	3.970.107
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	60.054.430	71.056.290	49.125.739	421.673.453	28.517.775	91.938.430	576.620.850
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	–	(2.926.950)	–	–	–	–	(500.965)
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		60.054.430	68.129.340	49.125.739	421.673.453	28.517.775	91.938.430	576.119.885
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>60.138.292</b>	<b>67.397.397</b>	<b>49.902.110</b>	<b>427.341.761</b>	<b>28.356.001</b>	<b>92.756.580</b>	<b>580.089.992</b>

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Hydrogen Economy UCITS ETF <sup>3</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G ESG Green Bond UCITS ETF <sup>4</sup> €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF <sup>5</sup> £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF <sup>5</sup> €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF <sup>5</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021  L&G Digital Payments UCITS ETF <sup>6</sup> \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		–	–	–	–	–	–
Abnahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(24.805.792)	(311.859)	231.876	(8.280)	644.345	99.751
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	490.084.085	23.492.442	26.220.960	16.303.574	19.142.830	6.175.085
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(5.551.845)	–	–	–	–	–
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		484.532.240	23.492.442	26.220.960	16.303.574	19.142.830	6.175.085
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>459.726.448</b>	<b>23.180.583</b>	<b>26.452.836</b>	<b>16.295.294</b>	<b>19.787.175</b>	<b>6.274.836</b>

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 3. Dezember 2020 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 15. Januar 2021 aufgelegt.

<sup>3</sup> Der Fonds wurde am 1. Februar 2021 aufgelegt.

<sup>4</sup> Der Fonds wurde am 11. Februar 2021 aufgelegt.

<sup>5</sup> Der Fonds wurde am 12. April 2021 aufgelegt.

<sup>6</sup> Der Fonds wurde am 25. Mai 2021 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

### 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 der 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.

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 62 bis 65 stellt die Summe der einzelnen Segmente dar, umgerechnet gemäß Anmerkung 1(H).

Der L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF wurde am 14. Januar 2022 geschlossen und bei der Zentralbank wurde ein Antrag auf Widerrufung der Zulassung des Fonds gestellt.

Der L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF, der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF und der L&G India INR Government Bond UCITS ETF wurden im Geschäftsjahr aufgelegt. Aus diesem Grund gibt es für sie keine Vergleichsdaten in den Abschlüssen.

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 2022 und zum 30. Juni 2021 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 Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### A. Grundlagen der Erstellung (Fortsetzung)

#### Neue Standards, Änderungen und Auslegungen mit Wirkung für das Geschäftsjahr ab dem 1. Juli 2021

- **IBOR-Reform - Phase 2 (Änderungen an IFRS 9, IAS 39, IFRS 7, IFRS 4 und IFRS 16)**

Die Änderungen betreffen Fragen, die sich im Zuge der Reform eines Referenzzinssatzes auf die Angebevorschriften auswirken könnten, unter anderem die Effekte von Änderungen an den vertraglich vereinbarten Zahlungsströmen oder an Sicherungsbeziehungen, die sich aus der Ersetzung eines Referenzzinssatzes durch einen alternativen Referenzzinssatz ergeben (Ersetzungsfragen). Die geänderten Vorschriften von IFRS 7, IFRS 9 und IAS 39 beziehen sich auf:

- Änderungen an der Grundlage für die Bestimmung vertraglich vereinbarter Zahlungsströme aus finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten,
- Bilanzierung von Sicherungsgeschäften und
- Angaben.

Die Änderungen der Phase 2 betreffen ausschließlich Änderungen an Finanzinstrumenten und Sicherungsbeziehungen, die durch die Reform der Referenzzinssätze erforderlich werden. Die Änderungen gelten rückwirkend, eine vorzeitige Anwendung ist zulässig. Sicherungsbeziehungen, die zuvor lediglich aufgrund von Veränderungen infolge der Reform beendet wurden, werden unter bestimmten Voraussetzungen wieder hergestellt. Die Änderung ist wirksam für am oder nach dem 1. Januar 2021 beginnende Berichtsjahre. Die Übernahme der Änderung hatte keine wesentliche Auswirkung auf den Abschluss der Gesellschaft.

Es gibt keine weiteren Standards, Änderungen an Standards oder Interpretationen, die seit dem 1. Juli 2021 in Kraft getreten sind.

#### Neue Standards, Änderungen und Auslegungen, die herausgegeben, aber für das Geschäftsjahr ab dem 1. Juli 2021 noch nicht in Kraft getreten waren und nicht frühzeitig angewendet wurden

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

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 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 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 2022 gab es keine Eventualverbindlichkeiten. Die Übernahme der Änderung hat daher voraussichtlich keine Auswirkung auf den Abschluss der Gesellschaft.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 2021 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 Änderung tritt in Kraft für am oder nach dem 1. Januar 2023 beginnende Geschäftsjahre und gilt 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.

Im Rahmen seines Projekts „Primary Financial Statements“ erarbeitet das IASB Vorschläge zur Verbesserung der Art und Weise, wie Informationen in Abschlüssen vermittelt werden. Das IASB schlägt vor, Anforderungen in einem neuen IFRS-Standard zu veröffentlichen, der IAS 1 ersetzen würde. 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.

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

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

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

Beim Erstantritt 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.

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, dass 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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

#### **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.

#### **(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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

#### Umklassifizierungen (Fortsetzung)

##### (ii) Wertminderung finanzieller Vermögenswerte (Fortsetzung)

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 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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

##### **Finanzielle Vermögenswerte mit objektivem Hinweis auf Wertminderung durch Kreditausfälle (Fortsetzung)**

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.

##### **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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

###### (iv) Grundsätze der Zeitwertbewertung (Fortsetzung)

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.

###### (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 Effektivzinismethode 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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

###### (vii) Derivate – OTC-Swaps (Fortsetzung)

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).

Die Fonds mit synthetischer Nachbildung setzen für die mit der Barclays Bank Plc, Citigroup Global Markets Limited und der 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 nachfolgenden Abschnitt *„Im Rahmen einer Wiederverkaufsvereinbarung gekaufte Wertpapiere“* und den Abschnitt *„(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“* in 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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

###### (viii) Derivative – Währungsabsicherungspolitik (Fortsetzung)

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. 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 nicht als Wertpapierkäufe ausgewiesen, sondern als Forderungen, und 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 Forderung aus umgekehrten Pensionsgeschäften zum beizulegenden Zeitwert geführt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

###### (ix) Im Rahmen einer Wiederverkaufsvereinbarung gekaufte Wertpapiere (Fortsetzung)

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“ in Anmerkung 12 („Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken“),

###### (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“ in 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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### 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. Dividendenerträge

Dividendenerträge sind die auf Stammaktien erzielten Erträge und werden in der Gesamtergebnisrechnung an den Terminen ausgewiesen, an denen die betreffenden Wertpapiere „ex-Dividende“ notiert werden. Dividendenerträge 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.

##### F. Rückkaufbare, gewinnberechtignte Anteile

Rückkaufbare, gewinnberechtignte Anteile sind auf Verlangen des Anteilinhabers zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Rückkaufbare, gewinnberechtignte Anteile können jederzeit gegen Barzahlung entsprechend dem Anteil am NIW des betreffenden Fonds zurückgegeben werden. Ein rückkaufbarer, gewinnberechtignter 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, gewinnberechtignten Anteile werden zum aktuellen Wert der Rückzahlungsbeträge bewertet.

##### G. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtignter Anteile

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

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### 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 Wechselkursverlust von (104.591.00 US\$) (30. Juni 2021: Wechselkursgewinn in Höhe von 23.281.137 US\$) in der Gesamtergebnisrechnung ist durch die Anwendung von durchschnittlichen Wechselkursen und die Veränderung der Wechselkurse zwischen Beginn und Ende des Berichtszeitraums bedingt. Dies ist eine nominale Wechselkursbereinigung und hat keine Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der einzelnen Fonds.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### 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.

##### 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022				
	Insgesamt	L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF <sup>1</sup>
	\$	\$	€	€	\$	£	£	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	406.515.782	1.102.400	(14.227)	(23.494)	421.776	(26)	(26)	(2.303.061)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	548.718.169	(7.368)	(8.312.883)	11.023.711	305.979.767	1.993.700	102.916	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(5.089.488)	7.037	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(3.356.498.487)	(6.554.498)	196	221	–	–	–	(7.519.618)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	(154.188.894)	–	(1.851.069)	2.484.754	(81.910.227)	411.532	(256.636)	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(153.576)	6.930	–	–	–	–	–	–
	<b>(2.560.696.494)</b>	<b>(5.445.499)</b>	<b>(10.177.983)</b>	<b>13.485.192</b>	<b>224.491.316</b>	<b>2.405.206</b>	<b>(153.746)</b>	<b>(9.822.679)</b>

	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	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 All Commodities 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	(57.939)	–	9.710.652	336.967
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(31.616)	(532.738)	(17.700)	(169.164)	35.053.173	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)	–	–	(9.885.138)	(350.603)	(3)	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(3.198)	–	3.542	91	–	–	(1.029)	124
	<b>(40.517.366)</b>	<b>(559.909)</b>	<b>(379.835.818)</b>	<b>(899.824.960)</b>	<b>25.110.096</b>	<b>449.657</b>	<b>(233.074.225)</b>	<b>(6.798.730)</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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						
	L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	L&G US Equity UCITS ETF	L&G UK Equity UCITS ETF	L&G Japan Equity UCITS ETF	L&G Global Equity UCITS ETF	L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	L&G Clean Water UCITS ETF	
	\$	\$	£	\$	\$	€	\$	\$	
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	38.873.031	13.599.065	270.345	862.505	395.904	1.408.482	(545.510)	5.217.945	
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	18.480	–	321	–	(1)	(238)	–	(11.463)	
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(242.195)	548	882	(274.347)	(7.460)	(4.217)	(73.427)	(44.223)	
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(180.544.812)	(67.810.923)	460.282	(57.348.899)	(10.943.591)	(16.228.111)	(44.215.675)	(80.339.604)	
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–	–	–	–	–	(22)	
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	49.228	1	279	2.636	84	74	5.436	(4.471)	
	<b>(141.846.268)</b>	<b>(54.211.309)</b>	<b>732.109</b>	<b>(56.758.105)</b>	<b>(10.555.064)</b>	<b>(14.824.010)</b>	<b>(44.829.176)</b>	<b>(75.181.838)</b>	

	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	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
	L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	L&G Clean Energy 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 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	
	<b>(128.361.312)</b>	<b>(89.238.378)</b>	<b>(6.716.798)</b>	<b>(170.699.143)</b>	<b>(45.489.231)</b>	<b>(4.368.267)</b>	<b>(12.899.016)</b>	<b>(10.683.579)</b>	

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022
	L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF	L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF	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 UK UCITS ETF	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex- UK UCITS ETF
	\$	£	\$	\$	\$	€	£	€
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	7.884.204	(442.665)	(168.888)	(57.869.439)	(40.475.767)	(2.547.111)	(1.931.004)	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	1.802	(4.400)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(8.898.199)	(505.229)	(13.611.853)	(107.429.188)	(227.311.109)	(868.330)	(1.595.624)	(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)	2.348	19
	<b>(1.204.005)</b>	<b>(947.894)</b>	<b>(13.780.741)</b>	<b>(210.172.781)</b>	<b>(268.008.922)</b>	<b>(3.414.919)</b>	<b>(3.522.478)</b>	<b>(2.229.017)</b>

	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 <sup>1</sup>	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>2</sup>	L&G India INR Government Bond UCITS ETF <sup>3</sup>
	\$	\$	\$	\$	\$
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)
	<b>(4.661.908)</b>	<b>(8.606.498)</b>	<b>183.087.549</b>	<b>(3.072.243)</b>	<b>(28.780.493)</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>2</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>3</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021				
	Insgesamt	L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF
	\$	\$	€	€	\$	£	£	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	844.455.533	6.838.184	(16.488)	(20.728)	–	–	(3)	116.281
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	304.086.635	–	14.052.801	(30.620.659)	270.422.212	5.863.036	(3.843.094)	15.189.668
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(967.060)	24.446	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	1.335.696.749	2.645.789	(176)	11	–	–	–	1.074.432
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	25.551.155	–	(424.677)	1.318.553	35.949.627	184.778	(473.142)	(284.054)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	1.405.352	(8.100)	–	–	–	–	–	–
	<b>2.510.228.364</b>	<b>9.500.319</b>	<b>13.611.460</b>	<b>(29.322.823)</b>	<b>306.371.839</b>	<b>6.047.814</b>	<b>(4.316.239)</b>	<b>16.096.327</b>

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021
	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 All Commodities 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	1.750.793	(1)	220.824.212	321.308.174	21.981.314	3.041.532	73.657.961	3.388.728
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	21.156.388	14.208.681	(3.161)	231.862	(161.911)	(25.818)	(691)	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(24.851)	–	(398.974)	152.760	–	–	(261.792)	(4.145)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(7.707.260)	–	211.860.410	290.768.095	–	–	139.766.039	(406.625)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	(13.355.572)	(601.727)	–	–	2.847.688	317.298	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	359	–	815	(142)	–	–	(783)	(36)
	<b>1.819.857</b>	<b>13.606.953</b>	<b>432.283.302</b>	<b>612.460.749</b>	<b>24.667.091</b>	<b>3.333.012</b>	<b>213.160.734</b>	<b>2.977.922</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021						
	L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	L&G US Equity UCITS ETF	L&G UK Equity UCITS ETF	L&G Japan Equity UCITS ETF	L&G Global Equity UCITS ETF	L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	L&G Clean Water UCITS ETF
	\$	\$	£	\$	\$	€	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	33.151.158	2.297.257	(168.101)	5.126.620	257.739	9.128.832	465.855	6.372.095
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	100.631	–	–	23	–	180	(220)	625
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(125.933)	–	1.037	(23.247)	1.274	(4.797)	(34.718)	(8.347)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	113.417.189	73.913.297	1.998.665	32.103.765	12.167.166	19.806.505	23.492.179	19.564.063
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(10.968)	–	(120)	(2.757)	(815)	–	(13.419)	(5.047)
	<b>146.532.077</b>	<b>76.210.554</b>	<b>1.831.481</b>	<b>37.204.404</b>	<b>12.425.364</b>	<b>28.930.720</b>	<b>23.909.677</b>	<b>25.923.389</b>

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021
	L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	L&G Clean Energy 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 UCITS ETF
	\$	\$	€	\$	\$	£	£	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	29.120.279	15.511.852	1.685.243	95.151.216	(2.539.083)	(29.583)	(187.395)	207.430
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(253)	(25)	1.094	–	(290)	–	–	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(12.708)	(8.474)	(9.370)	–	(23.521)	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	32.078.473	12.766.703	33.281.730	335.084.142	(1.195.209)	(67.681)	(1.064.224)	1.876
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(88)	6	925	–	(197)	–	–	–
	<b>61.185.703</b>	<b>28.270.062</b>	<b>34.959.622</b>	<b>430.235.358</b>	<b>(3.758.300)</b>	<b>(97.264)</b>	<b>(1.251.619)</b>	<b>209.306</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021
	L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF	L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF	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 UK UCITS ETF	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex- UK UCITS ETF
	\$	£	\$	\$	\$	€	£	€
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	149.576	(2.525)	169.464	3.186.583	(9.576.431)	(34.907)	118.796	15.454
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(6.491)	–	–	–	–	9.359	–	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(21.577)	–	–	–	(171.811)	(4.714)	(600)	(853)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	1.528.938	(145.330)	216.894	(5.106.634)	(16.742.429)	(424.556)	87.020	(81.938)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	1.309.000	–	–	–	(3.769)	117.925	(701)	1
	<b>2.959.446</b>	<b>(147.855)</b>	<b>386.358</b>	<b>(1.920.051)</b>	<b>(26.494.440)</b>	<b>(336.893)</b>	<b>204.515</b>	<b>(67.336)</b>

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021
	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	L&G Digital Payments UCITS ETF
	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	14.008	19.374
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	–	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(2.109)	(298)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	590.325	79.539
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(437)	–
	<b>601.787</b>	<b>98.615</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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. Beispielsweise kann der L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF Barbestände in US-Dollar oder chinesischen Renminbi oder in beiden Währungen halten. Die liquiden Mittel des L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF enthalten zum 30. Juni 2022 einen gesperrten Barbetrag von 5.704 US\$ (30. Juni 2021: 16.464 US\$), der bei der HSBC Securities Services mit einer Verfügungsbeschränkung zugunsten der China Securities Depository and Clearing Corp aufgrund der Mindestreservevorschriften für das Handeln von A-Aktien am chinesischen Aktienmarkt gehalten wird.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 4. Zahlungsmittel, Zahlungsmitteläquivalente und Kontokorrentverbindlichkeiten (Fortsetzung)

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. 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 2022 und 30. Juni 2021 werden als unwesentlich in Bezug auf den jeweiligen Fonds erachtet, an den sie fällig sind. Hiervon ausgenommen sind der L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF und der L&G ESG Green Bond UCITS ETF, die in der Position „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz zum 30. Juni 2022 (L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF und L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF zum 30. Juni 2021) 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 2022 und zum 30. Juni 2021 aufgeführt:

Fonds	Kontrahent	Beizulegender Zeitwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2022	Beizulegender Zeitwert der Sicherheiten zum 30. Juni 2022*	% der Position
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Merrill Lynch International	27.076.328 €	26.798.895 €	99 %
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Merrill Lynch International	36.774.800 €	37.021.564 €	101 %
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	623.438.724 \$	670.942.217 \$	108 %
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	16.159.757 £	16.206.133 £	100 %
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	10.443.751 £	10.404.256 £	100 %
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	29.294.923 \$	32.066.181 \$	109 %
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	102.009.070 \$	111.701.822 \$	110 %
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>	Barclays Bank Plc	795.902.955 \$	863.489.204 \$	108 %
<b>Gesellschaft insgesamt</b>		<b>1.649.707.629 \$</b>	<b>1.777.237.675 \$</b>	

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

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

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 5. Sicherheiten (Fortsetzung)

#### (i) Für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltene Sicherheiten (Fortsetzung)

Fonds	Kontrahent	Beizulegender Zeitwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021	Beizulegender Zeitwert der Sicherheiten zum 30. Juni 2021*	% der Position
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Merrill Lynch International	24.266.328 €	24.300.632 €	100 %
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Merrill Lynch International	44.148.270 €	43.641.515 €	99 %
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	1.103.956.000 \$	1.164.898.891 \$	106 %
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	17.820.000 £	17.835.812 £	100 %
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	10.588.751 £	10.567.630 £	100 %
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Merrill Lynch International	36.548.923 \$	40.203.818 \$	110 %
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	83.859.070 \$	90.371.233 \$	108 %
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	Barclays Bank Plc	10.061.553 \$	10.908.414 \$	108 %
<b>Gesellschaft insgesamt</b>		<b>1.354.803.398 \$</b>	<b>1.426.192.597 \$</b>	

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

#### (ii) Von Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten

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 DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	1.140.000 €	–	–	1.140.000 €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	–	–	28.330.000 \$	28.330.000 \$
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	470.000 £	–	–	470.000 £
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	–	90.620 \$	–	90.620 \$
L&G All Commodities UCITS ETF	–	–	3.770.000 \$	3.770.000 \$
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>	–	–	21.010.000 \$	21.010.000 \$
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	<b>1.762.607 \$</b>	<b>90.620 \$</b>	<b>53.110.000 \$</b>	<b>54.963.227 \$</b>

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

Von Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten	Merrill Lynch International Zum 30. Juni 2021	Citigroup Global Markets Limited Zum 30. Juni 2021	Barclays Bank Plc Zum 30. Juni 2021	Gesellschaft insgesamt Zum 30. Juni 2021
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	580.000 €	–	–	580.000 €
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	60.000 £	–	–	60.000 £
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	–	1.679.894 \$	–	1.679.894 \$
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	<b>770.707 \$</b>	<b>1.679.894 \$</b>	<b>–</b>	<b>2.450.601 \$</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 5. Sicherheiten (Fortsetzung)

#### (iii) Bei Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten

Bei 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 DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	1.470.000 €	–	–	1.470.000 €
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	1.050.000 £	–	–	1.050.000 £
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	<b>2.811.988 \$</b>	–	–	<b>2.811.988 \$</b>

Bei Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten	Merrill Lynch International Zum 30. Juni 2021	Citigroup Global Markets Limited Zum 30. Juni 2021	Barclays Bank Plc Zum 30. Juni 2021	Gesellschaft insgesamt Zum 30. Juni 2021
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	290.000 €	–	–	290.000 €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	–	–	20.500.000 \$	20.500.000 \$
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	270.000 £	–	–	270.000 £
L&G All Commodities UCITS ETF	–	–	1.500.000 \$	1.500.000 \$
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	–	–	160.017 \$	160.017 \$
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	<b>716.901 \$</b>	–	<b>22.160.017 \$</b>	<b>22.876.918 \$</b>

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

### 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 gewinnberechtigende 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, gewinnberechtigenden Anteilen entspricht zu jedem Zeitpunkt dem NIW der Gesellschaft. Rückkaufbare, gewinnberechtigende Anteile sind auf Verlangen des Anteilinhabers zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 6. Grundkapital (Fortsetzung)

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

Anteilklasse	Eröffnungsbestand – am 1. Juli 2021 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2022 ausgegebene Anteile
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF - USD Accumulating ETF	1.980.000	150.000	(450.000)	1.680.000
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	67.009	93.581	(47.125)	113.465
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	27.458.366	35.453.000	(42.474.351)	20.437.015
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 FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	67.231	178.571	(186.725)	59.077
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	2.451.608	8.406.076	(8.135.000)	2.722.684
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF - USD Accumulating ETF	392.767	105.000	(60.000)	437.767
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 All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	7.920.310	5.402.000	(6.103.400)	7.218.910
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF - USD Accumulating ETF <sup>1</sup>	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 US Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	17.803.271	12.145.463	(3.200.000)	26.748.734
L&G UK Equity UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	1.540.000	2.400.000	–	3.940.000
L&G Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	19.445.000	10.410.000	(2.800.000)	27.055.000
L&G Global Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	3.300.000	900.000	–	4.200.000
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	8.180.988	7.726.177	(100.000)	15.807.165
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	12.696.064	10.759.000	(640.000)	22.815.064
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 Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	17.965.798	480.000	(10.602.151)	7.843.647
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	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 <sup>2</sup>	–	660.000	–	660.000
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	41.100.000	8.094.570	(31.643.961)	17.550.609
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF <sup>3</sup>	–	6.896.085	–	6.896.085
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF	2.850.000	750.000	(1.350.000)	2.250.000
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	9.300.000	2.200.000	(800.000)	10.700.000
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

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 6. Grundkapital (Fortsetzung)

	Eröffnungsbestand – am 1. Juli 2021 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2022 ausgegebene Anteile
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 <sup>4</sup>	–	21.265.157	(676.216)	20.588.941
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Accumulating ETF <sup>4</sup>	–	56.858.261	(12.142.764)	44.715.497
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - GBP Hedged Distributing ETF <sup>4</sup>	–	513.137	–	513.137
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Distributing ETF <sup>3</sup>	–	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	2.350.000	445.000	(1.834.761)	960.239
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF - GBP Distributing ETF	2.600.000	2.003.736	–	4.603.736
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 <sup>6</sup>	–	63.371.283	(3.350.001)	60.021.282
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>7</sup>	–	2.300.000	(400.000)	1.900.000
L&G India INR Government Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>8</sup>	–	30.900.000	(600.000)	30.300.000

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde am 14. Januar 2022 geschlossen.

<sup>2</sup>Die Anteilklasse wurde am 6. Mai 2022 aufgelegt.

<sup>3</sup>Die Anteilklasse wurde am 21. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>4</sup>Die Anteilklasse wurde am 20. August 2021 aufgelegt.

<sup>5</sup>Die Anteilklasse wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

<sup>6</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>7</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>8</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

Die nachstehende Tabelle weist die zahlenmäßige Veränderung bei gewinnberechtigten Anteilen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 aus:

	Eröffnungsbestand – am 1. Juli 2020 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2021 ausgegebene Anteile
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF - USD Accumulating ETF	1.730.000	2.050.000	(1.800.000)	1.980.000
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	120.209	68.100	(121.300)	67.009
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	21.633.366	20.895.000	(15.070.000)	27.458.366
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	36.093.787	59.038.815	(26.830.000)	68.302.602
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	57.885	165.346	(156.000)	67.231
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	3.349.704	1.966.904	2.865.000	2.451.608
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF - USD Accumulating ETF	803.767	57.000	(468.000)	392.767
L&G Gold Mining UCITS ETF - USD Accumulating ETF	7.562.093	60.000	(2.990.000)	4.632.093
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF - USD Distributing ETF	4.911.066	3.634.173	(200.000)	8.345.239

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 6. Grundkapital (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle weist die zahlenmäßige Veränderung bei gewinnberechtigten Anteilen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 aus:

	Eröffnungs- bestand – am 1. Juli 2020 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurück- genommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2021 aus- gegebene Anteile
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF - USD Accumulating ETF	47.430.616	13.900.000	(12.905.000)	48.425.616
L&G Cyber Security UCITS ETF - USD Accumulating ETF	81.536.776	35.570.000	(7.225.000)	109.881.776
L&G All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	6.191.310	2.672.000	(943.000)	7.920.310
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF - USD Accumulating ETF	791.187	810.000	(781.909)	819.278
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF - USD Accumulating ETF	12.150.000	37.700.000	(4.400.000)	45.450.000
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	2.150.000	1.950.000	(1.500.000)	2.600.000
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF - USD Accumulating ETF	5.550.000	32.432.900	(3.750.000)	34.232.900
L&G US Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	11.767.267	6.136.004	(100.000)	17.803.271
L&G UK Equity UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	1.200.000	340.000	–	1.540.000
L&G Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	11.185.000	11.010.000	(2.750.000)	19.445.000
L&G Global Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	2.900.000	400.000	–	3.300.000
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	9.360.988	2.820.000	(4.000.000)	8.180.988
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	4.605.639	8.390.425	(300.000)	12.696.064
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	1.500.000	13.600.000	(450.000)	14.650.000
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF - USD Accumulating ETF	6.496.000	8.937.500	(1.850.000)	13.583.500
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	2.650.000	13.700.000	(5.200.000)	11.150.000
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	9.200.000	8.765.798	–	17.965.798
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	57.400.000	91.235.532	(34.135.532)	114.500.000
L&G Clean Energy UCITS ETF - USD Accumulating ETF <sup>1</sup>	–	9.900.000	(1.300.000)	8.600.000
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF <sup>2</sup>	–	6.000.000	–	6.000.000
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF - GBP Distributing ETF <sup>2</sup>	–	7.100.000	(300.000)	6.800.000
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>2</sup>	–	4.900.000	–	4.900.000
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>2</sup>	–	41.100.000	–	41.100.000
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF <sup>2</sup>	–	2.850.000	–	2.850.000
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>3</sup>	–	9.300.000	–	9.300.000
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF <sup>3</sup>	–	50.000	–	50.000
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF - USD Accumulating ETF <sup>4</sup>	–	52.550.000	(650.000)	51.900.000
L&G ESG Green Bond UCITS ETF - EUR Distributing ETF <sup>5</sup>	–	2.350.000	–	2.350.000
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF - GBP Distributing ETF <sup>6</sup>	–	2.600.000	–	2.600.000
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF - EUR Distributing ETF <sup>6</sup>	–	1.634.080	–	1.634.080
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>6</sup>	–	1.900.000	–	1.900.000
L&G Digital Payments UCITS ETF - USD Accumulating ETF <sup>7</sup>	–	600.000	–	600.000

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 5. November 2020 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 3. Dezember 2020 aufgelegt.

<sup>3</sup> Der Fonds wurde am 15. Januar 2021 aufgelegt.

<sup>4</sup> Der Fonds wurde am 1. Februar 2021 aufgelegt.

<sup>5</sup> Der Fonds wurde am 11. Februar 2021 aufgelegt.

<sup>6</sup> Der Fonds wurde am 12. April 2021 aufgelegt.

<sup>7</sup> Der Fonds wurde am 25. Mai 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 6. Grundkapital (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle zeigt die Geldwerte der Kern- und der abgesicherten Anteilklassen für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021:

	Erlöse aus im Geschäftsjahr ausgegebenen Anteilen in Lokalwährung 30. Juni 2022	Zahlungen für im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile in Lokalwährung 30. Juni 2022	Erlöse aus im Geschäftsjahr ausgegebenen Anteilen in Lokalwährung 30. Juni 2021	Zahlungen für im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile in Lokalwährung 30. Juni 2021
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - USD Distributing ETF	37.910.719 \$	(4.858.914) \$	49.125.739 \$	-
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF <sup>1</sup>	6.568.170 €	-	n. zutr.	n. zutr.
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	84.655.206 \$	(333.105.269) \$	421.673.453 \$	-
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF <sup>2</sup>	71.433.692 €	-	n. zutr.	n. zutr.
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Distributing ETF	416.729.223 \$	(656.985.154) \$	576.120.850 \$	500.965 \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	250.852.874 \$	(173.691.286) \$	500.000 \$	-
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - EUR Hedged Accumulating ETF <sup>2</sup>	206.450.865 €	(6.360.465) €	n. zutr.	n. zutr.
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Accumulating ETF <sup>3</sup>	553.735.428 CHF	(116.582.634) CHF	n. zutr.	n. zutr.
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - GBP Hedged Distributing ETF <sup>3</sup>	5.035.628 £	-	n. zutr.	n. zutr.
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Distributing ETF <sup>4</sup>	14.853.637 CHF	(979.467) CHF	n. zutr.	n. zutr.

<sup>1</sup>Die Anteilklasse wurde am 6. Mai 2022 aufgelegt.

<sup>2</sup>Die Anteilklasse wurde am 21. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>3</sup>Die Anteilklasse wurde am 20. August 2021 aufgelegt.

<sup>4</sup>Die Anteilklasse wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

#### 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 2022 und zum 30. Juni 2021 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 2022 bzw. 30. Juni 2021 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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 8. Wesentliche Vereinbarungen und Transaktionen mit verbundenen Parteien

##### Die Verwaltungsgesellschaft

Die Gesellschaft zahlt aus dem Vermögen der einzelnen Fonds eine feste Gesamtkostenquote („TER“) an die Verwaltungsgesellschaft 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. Mit Wirkung vom 22. Februar 2021 änderte der L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF seine TER von 0,45 % auf 0,30 %. Die TER für die abgesicherten Anteilsklassen des L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF wurde mit Wirkung vom 1. Oktober 2021 bis zum 4. Januar 2022 für einen Zeitraum von drei Monaten auf 0,19 % gesenkt und anschließend wieder auf 0,38 % angehoben. Während der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 hat es keine Änderungen an den TERs der anderen 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, die 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 2022 insgesamt angefallenen Verwaltungsgebühren (TER) beliefen sich auf 58.784.798 US\$ (30. Juni 2021: 41.356.860 US\$), von denen 4.414.816 US\$ (30. Juni 2021: 4.667.670 US\$) zum 30. Juni 2022 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.

Die Gesellschaft kann gemäß IAS 24 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 2022 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 6.313.169 US\$ (30. Juni 2021: 4.934.260 US\$) und der Betrag der im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 vereinnahmten Erträge auf 10.492 US\$ (30. Juni 2021: 270 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
- Bluefin Europe LLP
- Citigroup Global Markets Ltd
- Credit Suisse Securities (Europe) Limited
- DRW Europe B.V.
- Flow Traders B.V.
- HSBC Bank PLC
- Jane Street Financial Ltd
- JP Morgan Securities PLC
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley and Co. International PLC
- Optiver V.O.F.
- Susquehanna International Securities
- Societe Generale SA
- Virtu Financial Ireland Limited

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

#### 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 € (30. Juni 2021: 45.000€, 43.027 € bzw. 11.726 €) für der Gesellschaft im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 erbrachte Dienstleistungen.

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

Am 31. März 2021 legten Herr Adrian Waters und Frau Eimear Cowhey ihre Ämter als unabhängige nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft nieder. Herr Waters und Frau Cowhey erhielten für ihre Dienste für die Gesellschaft im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 ein Honorar von 33.750 € bzw. 30.000 €. Diese Anmerkung wurde ausschließlich zu Vergleichszwecken aufgenommen.

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 2022 und 30. Juni 2021 noch zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahres Beteiligungen an der Gesellschaft.

Die Zeichneranteile werden von LGIMH und der Verwaltungsgesellschaft gehalten.

### 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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 9. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

In Bezug auf die Fonds mit synthetischer Nachbildung ist die Gesellschaft eine 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.

In Bezug auf den L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF werden die (aus Zeichnungen stammenden) liquiden Mittel des Fonds von US-Dollar (US\$) in chinesische Yuan Renminbi (RMB) zum Kauf inländischer chinesischer Aktien umgerechnet. Umgekehrt wird bei einer Rücknahme ein Teil der chinesischen Aktien verkauft, und der Erlös wird von RMB wieder in US\$ konvertiert. Überschüssige Vorfinanzierungsbeträge im Zusammenhang mit einer Zeichnung müssen ebenfalls von RMB wieder in US\$ zur Rückzahlung an den jeweiligen autorisierten Teilnehmer umgerechnet werden. Die Devisengeschäfte werden mit The Bank of New York Mellon (ein mit der Verwahrstelle und dem Verwalter verbundenes Unternehmen) getätigt und werden vom Untieranlageverwalter für den Fonds angewiesen.

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 Untieranlageverwalters 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.

#### 10. Vergütung der Abschlussprüfer

Die für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 berechneten Honorare für die Abschlussprüfung werden von der Verwaltungsgesellschaft getragen. Von Ernst & Young wurden als Abschlussprüfer der Gesellschaft für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2022 bzw. 30. Juni 2021 keine sonstigen Assurance-Dienstleistungen oder sonstigen prüfungsfremden Leistungen erbracht. In der folgenden Tabelle sind die im jeweiligen Geschäftsjahr berechneten Gebühren ohne MwSt. aufgeführt.

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 €
Gesetzlich vorgeschriebene Prüfung	256.385	217.500
Sonstige Assurance-Dienstleistungen	-	-
Sonstige prüfungsfremde Leistungen	-	-

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 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 Libor-/Euribor-/ (ab August 2021) SONIA-Satz, zuzüglich eines Spread, 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 2022 und 30. Juni 2021 aufgeführt.

Fonds	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	(140.005) €	(86.993) €
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	220.597 €	356.438 €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	(4.283.875) \$	(2.140.857) \$
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	(332.218) £	(245.095) £
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	(102.109) £	(58.295) £
L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF <sup>1</sup>	n. zutr.	24.960 \$
L&G Gold Mining UCITS ETF <sup>1</sup>	n. zutr.	(931.612) \$
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	(291.373) \$	(125.249) \$
L&G All Commodities UCITS ETF	(542.942) \$	(161.911) \$
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF <sup>2</sup>	(3.656) \$	(25.818) \$
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>3</sup>	(3.366.652) \$	n. zutr.
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	<b>(8.975.116) \$</b>	<b>(3.447.344) \$</b>

<sup>1</sup> Am 22. Februar 2021 stellten diese Fonds ihre Strategie von der synthetischen auf die physische Indexnachbildung um.

<sup>2</sup> Dieser Fonds wurde am 14. Januar 2022 geschlossen.

<sup>3</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

#### 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 Preisrisiko, 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. In Bezug auf den L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungstätigkeiten (d. h. die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte des Fonds) an den jeweiligen Unteranlageverwalter unterdelegiert.

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

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

##### 1. Risikomanagement (Fortsetzung)

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.

Das Anlageziel des L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF ist ein Engagement an den Aktienmärkten Chinas. Um dieses Anlageziel zu erreichen, strebt der L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF die Nachbildung der Wertentwicklung des MSCI China A Onshore Index an, indem er überwiegend in ein optimiertes Portfolio von A-Aktien investiert, das sich – soweit möglich und praktikabel – aus den Wertpapieren des MSCI China A Onshore Index zusammensetzt. Die Wertpapiere des MSCI China A Onshore Index sind auch als „A-Aktien“ bezeichnete Aktienwerte, die von in Festlandchina gegründeten Unternehmen emittiert wurden, auf RMB lauten und in RMB an den Börsen in Shenzhen und Schanghai gehandelt werden.

Darüber hinaus setzen die Anlageverwalter beim täglichen Management der Anlagen der Gesellschaft in derivativen Finanzinstrumenten ein Risikomanagementprogramm ein. Im Zusammenhang mit dem L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF verfolgt der Untieranlageverwalter ein Risikomanagement in Bezug auf Anlagen der Gesellschaft in börsengehandelten Terminkontrakten (Futures). Der L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF hielt in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 keine Anlagen in Futures. Die zuvor erwähnten Risikomanagementprogramme werden von den Anlageverwaltern und vom Untieranlageverwalter eingesetzt, um die Risiken im Zusammenhang mit Anlagen der Fonds in die jeweiligen Arten derivativer Finanzinstrumente zu managen und zu überwachen.

#### 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 Anteilinhaber ausgesetzt sind. Zur Wahrung der Fähigkeit der Fonds, ihre Geschäfte fortzuführen und eine starke Kapitalbasis zu behalten, werden rückkaufbare, gewinnberechtigte 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 2022	30. Juni 2021
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	1.583.383 \$	2.117.399 \$
L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF	1.686.402 \$	1.935.502 \$
L&G Gold Mining UCITS ETF	6.338.141 \$	7.760.661 \$
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	40.078.329 \$	62.644.659 \$
L&G Cyber Security UCITS ETF	123.380.796 \$	139.417.947 \$
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	38.619.350 \$	41.625.480 \$
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	1.694.765 \$	1.713.532 \$
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	13.123.598 \$	30.519.518 \$
L&G US Equity UCITS ETF	19.264.192 \$	14.758.294 \$
L&G UK Equity UCITS ETF	2.255.621 £	830.099 £
L&G Japan Equity UCITS ETF	14.023.591 \$	12.555.507 \$
L&G Global Equity UCITS ETF	2.794.666 \$	2.562.241 \$
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	9.735.042 €	5.643.274 €
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	13.160.383 \$	8.634.425 \$
L&G Clean Water UCITS ETF	15.385.108 \$	11.577.702 \$
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	11.160.091 \$	12.762.485 \$
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	6.251.499 \$	10.953.328 \$
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	4.597.297 €	11.681.095 €
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	42.943.936 \$	85.175.814 \$

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (i) Preisrisiko (Fortsetzung)

	30. Juni 2022	30. Juni 2021
L&G Clean Energy UCITS ETF	8.758.632 \$	5.753.897 \$
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	3.412.956 £	2.971.943 £
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	4.146.201 £	3.327.646 £
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	3.916.742 \$	2.462.934 \$
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF	12.753.477 \$	21.034.220 \$
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF	1.077.716 £	1.410.390 £
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	4.507.207 \$	4.589.986 \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	47.542.801 \$	28.597.746 \$
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	24.759.700 \$	22.972.170 \$
L&G ESG Green Bond UCITS ETF	405.702 €	1.149.216 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF	2.129.562 £	1.313.390 £
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	1.061.782 €	808.562 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	1.049.007 \$	984.328 \$
L&G Digital Payments UCITS ETF	576.944 \$	313.289 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>1</sup>	781.201 \$	n. zutr.
L&G India INR Government Bond UCITS ETF <sup>2</sup>	13.840.719 \$	n. zutr.

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>2</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF, des L&G US Equity (Responsible Exclusions) 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, des L&G UK Gilt 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:

30. Juni 2022 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Chinesischer Yuan Renminbi	31.667.664	326.227	–	31.993.891
	<b>31.667.664</b>	<b>326.227</b>	<b>–</b>	<b>31.993.891</b>

30. Juni 2022 L&G Gold Mining UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -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
	<b>105.280.699</b>	<b>63.884</b>	<b>78.297</b>	<b>105.422.880</b>

30. Juni 2022 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -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
	<b>420.469.396</b>	<b>530.232</b>	<b>611.582</b>	<b>421.611.210</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
	<b>419.803.704</b>	<b>8.943</b>	<b>–</b>	<b>419.812.647</b>

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
	<b>620.872.226</b>	<b>145.380</b>	<b>633.491</b>	<b>621.651.097</b>

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
	<b>12.697.071</b>	<b>9.299</b>	<b>24.250</b>	<b>12.730.620</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
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
	<b>156.573.110</b>	<b>(1.086.611)</b>	<b>1.001.066</b>	<b>156.487.565</b>

30. Juni 2022 L&G US Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Kanadischer Dollar	–	(83)	–	(83)
	–	<b>(83)</b>	–	<b>(83)</b>

30. Juni 2022 L&G UK Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen £	Zahlungsmittel £	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten £	Summe Nettovermögen £
Euro	289.331	2.533	12.333	304.197
US-Dollar	460.100	5.491	6.631	472.222
	<b>749.431</b>	<b>8.024</b>	<b>18.964</b>	<b>776.419</b>

30. Juni 2022 L&G Japan Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Japanischer Yen	280.471.821	1.194.301	337.125	282.003.247
	<b>280.471.821</b>	<b>1.194.301</b>	<b>337.125</b>	<b>282.003.247</b>

30. Juni 2022 L&G Global Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	1.357.778	–	6.532	1.364.310
Kanadischer Dollar	1.922.040	3.892	3.002	1.928.934
Dänische Krone	438.287	546	–	438.833
Euro	4.648.190	200	3.938	4.652.328
Hongkong Dollar	488.271	4.129	1.385	493.785

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Global Equity UCITS ETF (Fortsetzung) Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Israelischer Schekel	125.041	915	–	125.956
Japanischer Yen	3.811.171	10.259	5.100	3.826.530
Neuseeland-Dollar	66.378	1.077	76	67.531
Norwegische Krone	137.881	2.466	–	140.347
Polnischer Zloty	22.311	439	–	22.750
Britisches Pfund	2.630.679	8.154	5.271	2.644.104
Singapur-Dollar	237.300	4.891	–	242.191
Schwedische Krone	551.997	1.675	–	553.672
Schweizer Franken	1.493.422	641	–	1.494.063
	<b>17.930.746</b>	<b>39.284</b>	<b>25.304</b>	<b>17.995.334</b>

30. Juni 2022 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten €	Summe Nettovermögen €
Australischer Dollar	276.032	2.310	–	278.342
Dänische Krone	11.007.258	312	–	11.007.570
Hongkong Dollar	86.254	435	–	86.689
Norwegische Krone	4.117.742	3.482	–	4.121.224
Polnischer Zloty	1.046.988	–	1.715	1.048.703
Schwedische Krone	14.458.855	1.719	3.391	14.463.965
Schweizer Franken	39.120.962	–	–	39.120.962
US-Dollar	2.514.015	1.615	5.355	2.520.985
	<b>72.628.106</b>	<b>9.873</b>	<b>10.461</b>	<b>72.648.440</b>

30. Juni 2022 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	156.169.559	473.996	553.047	157.196.602
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	1.207	1.207
Hongkong Dollar	64.379.043	26.809	(185.952)	64.219.900
Neuseeland-Dollar	6.457.554	–	11.167	6.468.721
Singapur-Dollar	28.077.193	18	(282.412)	27.794.799
	<b>255.083.349</b>	<b>500.823</b>	<b>97.057</b>	<b>255.681.229</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
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
	<b>110.021.006</b>	<b>217.277</b>	<b>280.206</b>	<b>110.518.489</b>

30. Juni 2022 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/ -verbindlichkeiten \$	Summe Nettovermögen \$
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
	<b>27.868.006</b>	<b>20.684</b>	<b>253.815</b>	<b>28.142.505</b>

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
	<b>20.858.120</b>	<b>12.293</b>	<b>–</b>	<b>20.870.413</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF 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
	<b>47.105.463</b>	<b>21.814</b>	<b>73.236</b>	<b>47.200.513</b>

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
	<b>132.754.570</b>	<b>4.826.204</b>	<b>62.668</b>	<b>137.643.442</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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\$	Festverzinsliche Anlagen \$	Termingeschäfte \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/(-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Euro	–	–	6.774.306	(123)	–	6.774.183
	–	–	<b>6.774.306</b>	<b>(123)</b>	–	<b>6.774.183</b>

30. Juni 2022 L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinsliche Anlagen \$	Termingeschäfte \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/(-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen/(-verbindlichkeiten) \$
Chinesischer Yuan Renminbi	–	255.069.539	–	102.743	3.441.782	258.614.064
Euro	–	–	–	(53.929)	–	(53.929)
	–	<b>255.069.539</b>	–	<b>48.814</b>	<b>3.441.782</b>	<b>258.560.135</b>

30. Juni 2022 L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko					
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinsliche Anlagen \$	Termingeschäfte \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/(-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
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
	–	–	<b>599.371.037</b>	<b>16.595</b>	–	<b>599.387.632</b>

30. Juni 2022 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/(-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
	<b>334.265.209</b>	<b>513.827</b>	<b>604.971</b>	<b>335.384.007</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Festverzinsliche Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-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
	<b>236.271</b>	<b>2.037.202</b>	<b>2.782</b>	<b>74.574</b>	<b>2.350.829</b>

30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettoverbind- lichkeiten £
	Anlagen £	Zahlungsmittel £	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) £	
US-Dollar	–	13.572	23.705	37.277
	–	<b>13.572</b>	<b>23.705</b>	<b>37.277</b>

30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-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
	<b>7.070.365</b>	<b>4.082</b>	–		<b>7.074.447</b>

30. Juni 2022 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	6.431.679	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
	<b>20.980.139</b>	<b>986</b>	<b>69.447</b>		<b>21.050.572</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
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
	<b>3.688.907</b>	<b>13.760</b>	–	<b>3.702.667</b>

30. Juni 2022 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>1</sup> Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte /(-verbindlichkeiten) \$	
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
	<b>15.557.030</b>	<b>57.371</b>	<b>151.302</b>	<b>15.765.703</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 <sup>2</sup> Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettovermögen \$
	Anlagen in variabel verzinslichen Schuldscheinen US\$	Festverzinsliche Anlagen \$	Barmittel US\$	Sonstige Nettovermögenswerte/(-verbindlichkeiten) \$	
Indische Rupie	–	276.814.385	40.476	2.541.026	279.395.887
	–	<b>276.814.385</b>	<b>40.476</b>	<b>2.541.026</b>	<b>279.395.887</b>

<sup>2</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

Die nachstehenden Tabellen weisen das Währungsrisiko der Fonds mit physischer Nachbildung (mit Ausnahme des L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF, des L&G US Equity UCITS ETF, des L&G US Equity (Responsible Exclusions) 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, des L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF, des L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF und des L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF, für die kein Währungsrisiko besteht) zum 30. Juni 2020 aus:

30. Juni 2021 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögen \$	
Chinesischer Yuan Renminbi	42.347.972	32.306.767	–	74.654.739
	<b>42.347.972</b>	<b>32.306.767</b>	–	<b>74.654.739</b>

30. Juni 2021 L&G Gold Mining UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögen \$	
Australischer Dollar	22.764.542	–	–	22.764.542
Kanadischer Dollar	69.176.674	(48.685)	–	69.127.989
Britisches Pfund	10.401.479	–	–	10.401.479
Südafrikanischer Rand	23.294.670	72.396	–	23.367.066
	<b>125.637.365</b>	<b>23.711</b>	–	<b>125.661.076</b>

30. Juni 2021 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögenswerte/(-verbindlichkeiten) \$	
Kanadischer Dollar	18.817.198	335	–	18.817.533
Chinesischer Yuan Renminbi	22.427.607	(14)	–	22.427.593
Euro	116.264.174	–	–	116.264.174
Japanischer Yen	239.721.559	204.846	376.421	240.302.826
Koreanischer Won	19.037.950	–	–	19.037.950
Britisches Pfund	43.717.758	542	–	43.718.300
Schwedische Krone	27.982.804	806	–	27.983.610
Schweizer Franken	51.651.253	1.341	–	51.652.594
Taiwanesischer Dollar	76.720.706	97.693	166.241	76.984.640
	<b>616.341.009</b>	<b>305.549</b>	<b>542.662</b>	<b>617.189.220</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2021 L&G Cyber Security UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Kanadischer Dollar	137.290.370	(96.444)	98.407	137.292.333
Euro	48.738.153	6.570	(6.657)	48.738.066
Japanischer Yen	121.936.065	–	–	121.936.065
Koreanischer Won	31.256.574	–	–	31.256.574
Britisches Pfund	159.139.206	(40.735)	40.725	159.139.196
Schwedische Krone	75.419.152	(20.912)	21.068	75.419.308
	<b>573.779.520</b>	<b>(151.521)</b>	<b>153.543</b>	<b>573.781.542</b>

30. Juni 2021 L&G Battery Value-Chain UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	75.292.359	–	–	75.292.359
Kanadischer Dollar	22.778.969	8.152	(6.280)	22.780.841
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	26.367	26.367
Euro	119.151.289	107	(1.031)	119.150.365
Hongkong Dollar	38.498.686	–	–	38.498.686
Japanischer Yen	183.100.415	514.942	(28.493)	183.586.864
Koreanischer Won	97.399.530	–	–	97.399.530
Britisches Pfund	22.022.418	(5.533)	5.389	22.022.274
Schweizer Franken	24.082.720	1.957	(1.958)	24.082.719
Taiwanesischer Dollar	24.849.091	–	–	24.849.091
	<b>607.175.477</b>	<b>519.625</b>	<b>(6.006)</b>	<b>607.689.096</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2021 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögen \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	1.062.178	–	–	1.062.178
Dänische Krone	1.269.793	–	–	1.269.793
Euro	4.036.833	665	–	4.037.498
Hongkong Dollar	869.670	–	4.210	873.880
Japanischer Yen	4.538.623	5.021	10.901	4.554.545
Britisches Pfund	827.023	–	–	827.023
Schwedische Krone	1.061.837	–	–	1.061.837
Schweizer Franken	2.158.076	–	–	2.158.076
	<b>15.824.033</b>	<b>5.686</b>	<b>15.111</b>	<b>15.844.830</b>

30. Juni 2021 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögen \$	Summe Nettovermögen \$
Kanadischer Dollar	31.517.187	(17.113)	–	31.500.074
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	512.134	512.134
Dänische Krone	31.826.676	4.023	–	31.830.699
Euro	91.300.079	71.821	–	91.371.900
Hongkong Dollar	26.902.194	–	–	26.902.194
Japanischer Yen	99.646.863	–	–	99.646.863
Koreanischer Won	12.812.075	–	–	12.812.075
Neuseeland-Dollar	12.033.653	–	–	12.033.653
Britisches Pfund	36.112.378	(12.173)	–	36.100.205
Schweizer Franken	15.521.131	67	–	15.521.198
Taiwanesischer Dollar	22.361.698	–	630.837	22.992.535
	<b>380.033.934</b>	<b>46.625</b>	<b>1.142.971</b>	<b>381.223.530</b>

30. Juni 2021 L&G UK Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen £	Zahlungsmittel £	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) £	Summe Nettovermögen £
Euro	106.174	878	9.686	116.738
US-Dollar	278.418	(5.965)	2.087	274.540
	<b>384.592</b>	<b>(5.087)</b>	<b>11.773</b>	<b>391.278</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2021 L&G Japan Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Japanischer Yen	251.110.148	1.317.360	242.212	252.669.720
	<b>251.110.148</b>	<b>1.317.360</b>	<b>242.212</b>	<b>252.669.720</b>

30. Juni 2021 L&G Global Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	1.132.459	810	5.723	1.138.992
Kanadischer Dollar	1.833.146	2.975	3.134	1.839.255
Dänische Krone	375.827	68	–	375.895
Euro	4.744.074	8.248	4.449	4.756.771
Hongkong Dollar	501.327	5.492	949	507.768
Israelischer Schekel	142.868	223	44	143.135
Japanischer Yen	3.825.539	18.431	4.277	3.848.247
Neuseeland-Dollar	62.049	167	84	62.300
Norwegische Krone	100.810	983	–	101.793
Polnischer Zloty	42.522	–	–	42.522
Britisches Pfund	2.354.409	4.285	4.407	2.363.101
Singapur-Dollar	163.428	2.496	–	165.924
Schwedische Krone	637.088	63	2.804	639.955
Schweizer Franken	1.281.093	1.222	–	1.282.315
	<b>17.196.639</b>	<b>45.463</b>	<b>25.871</b>	<b>17.267.973</b>

30. Juni 2021 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) €	
Australischer Dollar	179.719	(3.168)	–	176.551
Dänische Krone	5.708.127	4.008	–	5.712.135
Hongkong Dollar	51.208	–	–	51.208
Norwegische Krone	2.080.898	7.432	–	2.088.330
Polnischer Zloty	725.791	656	–	726.447
Schwedische Krone	9.482.622	25.212	28.615	9.536.449
Schweizer Franken	20.158.263	–	–	20.158.263
US-Dollar	1.025.359	5.227	1.858	1.032.444
	<b>39.411.987</b>	<b>39.367</b>	<b>30.473</b>	<b>39.481.827</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2021 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	101.191.929	121.433	399.624	101.712.986
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	1.828	1.828
Hongkong Dollar	47.967.842	56.646	106.412	48.130.900
Neuseeland-Dollar	5.014.412	6.360	7.117	5.027.889
Singapur-Dollar	16.100.664	89.955	1.832	16.192.451
	<b>170.274.847</b>	<b>274.394</b>	<b>516.813</b>	<b>171.066.054</b>

30. Juni 2021 L&G Clean Water UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Euro	18.615.795	(452)	48.792	18.664.135
Hongkong Dollar	14.744.713	100.621	228.765	15.074.099
Japanischer Yen	15.321.643	33.994	26.291	15.381.928
Britisches Pfund	22.148.172	–	232.426	22.380.598
Schwedische Krone	4.579.158	36	–	4.579.194
Schweizer Franken	10.280.276	–	–	10.280.276
	<b>85.689.757</b>	<b>134.199</b>	<b>536.274</b>	<b>86.360.230</b>

30. Juni 2021 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	3.547.613	–	–	3.547.613
Chinesischer Yuan Renminbi	966.213	(2)	–	966.211
Euro	6.855.262	–	676	6.855.938
Hongkong Dollar	5.604.448	–	–	5.604.448
Polnischer Zloty	2.581.231	2.176	137	2.583.544
Britisches Pfund	3.243.963	–	(76)	3.243.887
Taiwanesischer Dollar	8.113.963	19.848	11.153	8.144.964
	<b>30.912.693</b>	<b>22.022</b>	<b>11.890</b>	<b>30.946.605</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2021 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	2.131.850	–	–	2.131.850
Dänische Krone	1.832.654	–	–	1.832.654
Euro	11.092.087	(119)	(15.434)	11.076.534
Hongkong Dollar	7.707.803	–	–	7.707.803
Japanischer Yen	1.617.377	–	–	1.617.377
Britisches Pfund	3.549.821	–	–	3.549.821
Schweizer Franken	8.060.286	–	–	8.060.286
	<b>35.991.878</b>	<b>(119)</b>	<b>(15.434)</b>	<b>35.976.325</b>

30. Juni 2021 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) €	
Dänische Krone	9.174.770	–	–	9.174.770
Norwegische Krone	2.319.682	–	–	2.319.682
Polnischer Zloty	789.974	70	–	790.044
Britisches Pfund	48.217.473	5.097	137.338	48.359.908
Schwedische Krone	14.950.817	4.577	42.976	14.998.370
Schweizer Franken	35.784.155	–	2.936	35.787.091
US-Dollar	–	737	6.592	7.329
	<b>111.236.871</b>	<b>10.481</b>	<b>189.842</b>	<b>111.437.194</b>

30. Juni 2021 L&G Clean Energy UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	4.165.815	–	–	4.165.815
Kanadischer Dollar	6.285.993	–	9.325	6.295.318
Dänische Krone	4.144.950	–	–	4.144.950
Euro	33.996.341	21.900	–	34.018.241
Japanischer Yen	16.540.663	31.500	–	16.572.163
Koreanischer Won	5.204.416	–	–	5.204.416
Norwegische Krone	1.800.438	–	–	1.800.438
Britisches Pfund	1.915.666	–	–	1.915.666
Schwedische Krone	4.182.180	–	–	4.182.180
Taiwanesischer Dollar	6.287.614	–	54.208	6.341.822
	<b>84.524.076</b>	<b>53.400</b>	<b>63.533</b>	<b>84.641.009</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2021 L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Festverzinsliche Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Chinesischer Yuan Renminbi	–	420.684.390	529.398	6.118.089	427.331.877
	–	<b>420.684.390</b>	<b>529.398</b>	<b>6.118.089</b>	<b>427.331.877</b>

30. Juni 2021 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$		
Kanadischer Dollar	13.366.214	683	–	–	13.366.897
Dänische Krone	13.680.627	–	–	–	13.680.627
Euro	91.155.185	5.458	–	–	91.160.643
Hongkong Dollar	14.314.173	–	–	–	14.314.173
Japanischer Yen	45.183.775	–	–	–	45.183.775
Koreanischer Won	50.614.671	–	–	–	50.614.671
Norwegische Krone	14.023.264	–	–	–	14.023.264
Britisches Pfund	59.567.067	(1)	(1.135.275)	–	58.431.791
Schwedische Krone	34.400.369	–	–	–	34.400.369
	<b>336.305.345</b>	<b>6.140</b>	<b>(1.135.275)</b>		<b>335.176.210</b>

30. Juni 2021 L&G ESG Green Bond UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Festverzinsliche Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) €	
Britisches Pfund	114.265	414.578	3.699	(62.072)	470.470
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–
US-Dollar	508.839	4.515.056	96.292	(45.129)	5.075.058
	<b>623.104</b>	<b>4.929.634</b>	<b>99.991</b>	<b>(107.201)</b>	<b>5.545.528</b>

30. Juni 2021 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko				Summe Nettoverbind- lichkeiten £
	Anlagen £	Zahlungsmittel £	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) £		
US-Dollar	–	(34.886)	6.621	–	(28.265)
	–	<b>(34.886)</b>	<b>6.621</b>		<b>(28.265)</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

30. Juni 2021 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) €	Summe Nettovermögen €
Dänische Krone	284.683	64	–	284.747
Norwegische Krone	977.377	306	–	977.683
Polnischer Zloty	240.501	(61)	241	240.681
Schwedische Krone	1.289.872	165	–	1.290.037
Schweizer Franken	1.879.205	805	–	1.880.010
US-Dollar	–	–	–	–
	<b>4.671.638</b>	<b>1.279</b>	<b>241</b>	<b>4.673.158</b>

30. Juni 2021 L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	6.317.957	5.703	23.373	6.347.033
Hongkong Dollar	5.007.230	10.845	22.533	5.040.608
Koreanischer Won	5.187.017	–	4.088	5.191.105
Neuseeland-Dollar	1.862.915	3.999	–	1.866.914
Singapur-Dollar	1.311.450	8.286	–	1.319.736
	<b>19.686.569</b>	<b>28.833</b>	<b>49.994</b>	<b>19.765.396</b>

30. Juni 2021 L&G Digital Payments UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Nettovermögen \$
Australischer Dollar	313.480	–	–	313.480
Kanadischer Dollar	323.245	–	–	323.245
Euro	600.540	–	–	600.540
Hongkong Dollar	271.411	–	–	271.411
Japanischer Yen	297.875	–	–	297.875
Neuseeland-Dollar	141.635	–	–	141.635
Britisches Pfund	187.436	–	–	187.436
	<b>2.135.622</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.135.622</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (ii) Währungsrisiko (Fortsetzung)

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 2022	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % fällt 30. Juni 2022	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % steigt 30. Juni 2021	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % fällt 30. Juni 2021
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	(1.507.984) \$	1.666.719 \$	(2.015.378) \$	2.227.523 \$
L&G Gold Mining UCITS ETF	(5.013.367) \$	5.541.090 \$	(5.982.731) \$	6.612.492 \$
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	(20.022.352) \$	22.129.968 \$	(29.349.572) \$	32.439.000 \$
L&G Cyber Security UCITS ETF	(19.990.654) \$	22.094.934 \$	(27.322.833) \$	30.198.920 \$
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	(29.565.344) \$	32.677.486 \$	(28.913.118) \$	31.956.604 \$
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	(604.622) \$	668.267 \$	(753.525) \$	832.844 \$
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	(7.455.863) \$	8.240.690 \$	(18.096.854) \$	20.001.786 \$
L&G UK Equity UCITS ETF	(35.687) £	39.444 £	(18.314) £	20.242 £
L&G Japan Equity UCITS ETF	(13.355.801) \$	14.761.675 \$	(11.957.626) \$	13.216.324 \$
L&G Global Equity UCITS ETF	(853.845) \$	943.723 \$	(816.863) \$	902.848 \$
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	(3.458.481) €	3.822.532 €	(1.876.761) €	2.074.315 €
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	(12.146.826) \$	13.425.439 \$	(8.108.326) \$	8.961.834 \$
L&G Clean Water UCITS ETF	(5.239.096) \$	5.790.579 \$	(4.080.465) \$	4.509.987 \$
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	(1.327.048) \$	1.466.737 \$	(1.472.033) \$	1.626.984 \$
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	(993.244) \$	1.097.796 \$	(1.713.899) \$	1.894.309 \$
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	(2.243.117) €	2.479.235 €	(5.296.994) €	5.854.572 €
L&G Clean Energy UCITS ETF	(6.321.646) \$	6.987.083 \$	(4.024.956) \$	4.448.635 \$
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF	(12.146.169) \$	13.424.713 \$	(20.032.590) \$	22.141.284 \$
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	(15.917.391) \$	17.592.906 \$	(16.014.540) \$	17.700.281 \$
L&G ESG Green Bond UCITS ETF	(108.261) €	119.656 €	(264.416) €	292.249 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	(336.684) €	372.124 €	(222.459) €	245.876 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	(999.054) \$	1.104.218 \$	(937.456) \$	1.036.135 \$
L&G Digital Payments UCITS ETF	(175.662) \$	194.153 \$	(101.696) \$	112.401 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>1</sup>	(740.811) \$	818.791 \$	n. zutr.	n. zutr.
L&G India INR Government Bond UCITS ETF <sup>2</sup>	(13.181.637) \$	14.569.178 \$	n. zutr.	n. zutr.

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>2</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 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 Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF, 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 ESG China CNY Bond UCITS ETF, der L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF, der L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF, der L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF, der L&G ESG Green Bond 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, lauteten zum 30. Juni 2022 wie folgt:

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	Verzinslich					Nicht verzinslich	Insgesamt
	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre		
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	584.623	–	–	–	–	–	584.623
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	–	–	30.020	–	30.020
– Übertragbare Wertpapiere	–	–	–	–	–	263.177.639	263.177.639
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	804.861	804.861
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>584.623</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>30.020</b>	<b>263.982.500</b>	<b>264.597.143</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(707.804)	(707.804)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(20.604)	(20.604)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(728.408)</b>	<b>(728.408)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>584.623</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>30.020</b>	<b>263.254.092</b>	<b>263.868.735</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>6.860</b>	<b>221.780</b>	<b>5.902.887</b>	<b>61.402.317</b>	<b>732.136</b>	<b>1.915.021</b>	<b>70.181.001</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(1.279.597)	(1.279.597)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(5.111)	(5.111)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1.284.708)</b>	<b>(1.284.708)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>6.860</b>	<b>221.780</b>	<b>5.902.887</b>	<b>61.402.317</b>	<b>732.136</b>	<b>630.313</b>	<b>68.896.293</b>

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
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>284.218</b>	<b>200.379</b>	<b>1.050.813</b>	<b>26.738.327</b>	<b>54.934.503</b>	<b>2.064.207</b>	<b>85.272.447</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(595.513)	(595.513)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(6.107)	(6.107)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(601.620)</b>	<b>(601.620)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>284.218</b>	<b>200.379</b>	<b>1.050.813</b>	<b>26.738.327</b>	<b>54.934.503</b>	<b>1.462.587</b>	<b>84.670.827</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>114.723</b>	<b>–</b>	<b>8.013.529</b>	<b>65.972.553</b>	<b>4.348.752</b>	<b>3.750.216</b>	<b>82.199.773</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
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)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(2.561.142)</b>	<b>(2.561.142)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>114.723</b>	<b>–</b>	<b>8.013.529</b>	<b>65.972.553</b>	<b>4.348.752</b>	<b>1.189.074</b>	<b>79.638.631</b>

L&G ESG China CNY 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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>75.719</b>	<b>–</b>	<b>14.298.514</b>	<b>144.314.405</b>	<b>96.456.620</b>	<b>5.917.305</b>	<b>261.062.563</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(2.475.523)	(2.475.523)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(61.849)	(61.849)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(2.537.372)</b>	<b>(2.537.372)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>75.719</b>	<b>–</b>	<b>14.298.514</b>	<b>144.314.405</b>	<b>96.456.620</b>	<b>3.379.933</b>	<b>258.525.191</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G UK Gilt 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 verzins- lich	Insgesamt
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	11.957	–	–	–	–	–	11.957
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Investitionen in festverzinsliche Wertpapiere	–	–	1.675.905	19.878.410	–	–	21.554.315
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	122.393	122.393
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	88.447	88.447
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>11.957</b>	<b>–</b>	<b>1.675.905</b>	<b>19.878.410</b>	<b>–</b>	<b>210.840</b>	<b>21.777.112</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(126.511)	(126.511)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(1.255)	(1.255)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(127.766)</b>	<b>(127.766)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>11.957</b>	<b>–</b>	<b>1.675.905</b>	<b>19.878.410</b>	<b>–</b>	<b>83.074</b>	<b>21.649.346</b>

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 verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>66.362</b>	<b>170.100</b>	<b>3.514.253</b>	<b>34.212.288</b>	<b>52.247.506</b>	<b>2.915.806</b>	<b>93.126.315</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(1.664.636)	(1.664.636)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(6.579)	(6.579)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1.671.215)</b>	<b>(1.671.215)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>66.362</b>	<b>170.100</b>	<b>3.514.253</b>	<b>34.212.288</b>	<b>52.247.506</b>	<b>1.244.591</b>	<b>91.455.100</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>–</b>	<b>8.631.966</b>	<b>42.568.955</b>	<b>466.741.333</b>	<b>432.913.772</b>	<b>27.110.460</b>	<b>977.966.486</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
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)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(1.928.273)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(22.855.667)</b>	<b>(24.783.940)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>(1.928.273)</b>	<b>8.631.966</b>	<b>42.568.955</b>	<b>466.741.333</b>	<b>432.913.772</b>	<b>4.254.793</b>	<b>953.182.546</b>

L&G ESG Green 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
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>14.090.888</b>	<b>–</b>	<b>112.515</b>	<b>2.636.291</b>	<b>5.365.227</b>	<b>314.143</b>	<b>22.519.064</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(325.572)	(325.572)
Fällige Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	(14.045.988)	(14.045.988)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(3.904)	(3.904)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(14.375.464)</b>	<b>(14.375.464)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>14.090.888</b>	<b>–</b>	<b>112.515</b>	<b>2.636.291</b>	<b>5.365.227</b>	<b>(14.061.321)</b>	<b>8.143.600</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 <sup>1</sup>	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>101.692</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>93.037.137</b>	<b>183.777.248</b>	<b>7.995.013</b>	<b>284.911.090</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(5.453.987)	(5.453.987)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(89.932)	(89.932)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(5.543.919)</b>	<b>(5.543.919)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>101.692</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>93.037.137</b>	<b>183.777.248</b>	<b>2.451.094</b>	<b>279.367.171</b>

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

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 2021 wie folgt:

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	Verzinslich 3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	700.739	–	–	–	–	–	700.739
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Übertragbare Wertpapiere	–	–	–	–	31.158	172.657.337	172.688.495
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	822	822
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	515.991	515.991
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>700.739</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>31.158</b>	<b>173.174.150</b>	<b>173.906.047</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(14.372)	(14.372)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(14.372)</b>	<b>(14.372)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>700.739</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>31.158</b>	<b>173.159.778</b>	<b>173.891.675</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	284.636	–	–	–	–	–	284.636
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Übertragbare Wertpapiere	–	–	7.903.241	50.592.255	943.354	–	59.438.850
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	817.311	817.311
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	693.839	693.839
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>284.636</b>	<b>–</b>	<b>7.903.241</b>	<b>50.592.255</b>	<b>943.354</b>	<b>1.511.150</b>	<b>61.234.636</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(1.091.900)	(1.091.900)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(4.444)	(4.444)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1.096.344)</b>	<b>(1.096.344)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>284.636</b>	<b>–</b>	<b>7.903.241</b>	<b>50.592.255</b>	<b>943.354</b>	<b>414.806</b>	<b>60.138.292</b>

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
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	183.294	–	–	–	–	–	183.294
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Übertragbare Wertpapiere	–	–	1.683.086	17.061.174	47.808.655	–	66.552.915
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	791.641	791.641
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	846.882	846.882
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>183.294</b>	<b>–</b>	<b>1.683.086</b>	<b>17.061.174</b>	<b>47.808.655</b>	<b>1.638.523</b>	<b>68.374.732</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(972.376)	(972.376)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(4.959)	(4.959)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(977.335)</b>	<b>(977.335)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>183.294</b>	<b>–</b>	<b>1.683.086</b>	<b>17.061.174</b>	<b>47.808.655</b>	<b>661.188</b>	<b>67.397.397</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	72.663	–	–	–	–	–	72.663
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Übertragbare Wertpapiere	–	–	5.325.659	42.928.850	1.004.162	–	49.258.671
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	778.424	778.424
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	655.851	655.851
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>72.663</b>	<b>–</b>	<b>5.325.659</b>	<b>42.928.850</b>	<b>1.004.162</b>	<b>1.434.275</b>	<b>50.765.609</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(853.230)	(853.230)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(10.269)	(10.269)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(863.499)</b>	<b>(863.499)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>72.663</b>	<b>–</b>	<b>5.325.659</b>	<b>42.928.850</b>	<b>1.004.162</b>	<b>570.776</b>	<b>49.902.110</b>
L&G ESG China CNY 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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	628.837	–	–	–	–	–	628.837
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Übertragbare Wertpapiere	–	–	16.506.758	241.752.346	162.425.286	–	420.684.390
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	6.118.090	6.118.090
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>628.837</b>	<b>–</b>	<b>16.506.758</b>	<b>241.752.346</b>	<b>162.425.286</b>	<b>6.118.090</b>	<b>427.431.317</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(89.556)	(89.556)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(89.556)</b>	<b>(89.556)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>628.837</b>	<b>–</b>	<b>16.506.758</b>	<b>241.752.346</b>	<b>162.425.286</b>	<b>6.028.534</b>	<b>427.341.761</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

###### (iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G UK Gilt 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 verzins- lich	Insgesamt
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	98.269	–	–	–	–	–	98.269
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Übertragbare Wertpapiere	–	166.135	2.239.378	25.802.290	–	–	28.207.803
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	132.952	132.952
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>98.269</b>	<b>166.135</b>	<b>2.239.378</b>	<b>25.802.290</b>	<b>–</b>	<b>132.952</b>	<b>28.439.024</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(81.625)	(81.625)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(1.398)	(1.398)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(83.023)</b>	<b>(83.023)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>98.269</b>	<b>166.135</b>	<b>2.239.378</b>	<b>25.802.290</b>	<b>–</b>	<b>49.929</b>	<b>28.356.001</b>

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 verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	626.689	–	–	–	–	–	626.689
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Übertragbare Wertpapiere	–	329.829	3.417.951	30.071.478	57.980.456	–	91.799.714
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	734.659	734.659
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>626.689</b>	<b>329.829</b>	<b>3.417.951</b>	<b>30.071.478</b>	<b>57.980.456</b>	<b>734.659</b>	<b>93.161.062</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(397.973)	(397.973)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(6.509)	(6.509)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(404.482)</b>	<b>(404.482)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>626.689</b>	<b>329.829</b>	<b>3.417.951</b>	<b>30.071.478</b>	<b>57.980.456</b>	<b>330.177</b>	<b>92.756.580</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	3.848.839	–	–	–	–	–	3.848.839
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Übertragbare Wertpapiere	449.662	3.414.941	24.733.616	278.560.301	264.796.400	–	571.954.920
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	9.306.248	9.306.248
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	6.310.789	6.310.789
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>4.298.501</b>	<b>3.414.941</b>	<b>24.733.616</b>	<b>278.560.301</b>	<b>264.796.400</b>	<b>15.617.037</b>	<b>591.420.796</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(11.166.455)	(11.166.455)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(164.349)	(164.349)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(11.330.804)</b>	<b>(11.330.804)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>4.298.501</b>	<b>3.414.941</b>	<b>24.733.616</b>	<b>278.560.301</b>	<b>264.796.400</b>	<b>4.286.233</b>	<b>580.089.992</b>

L&G ESG Green 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
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	144.608	–	–	–	–	–	144.608
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Übertragbare Wertpapiere	–	–	168.977	6.203.856	16.611.479	–	22.984.312
Forderungen aus verkauften Wertpapieren	–	–	–	–	–	653.236	653.236
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	97.875	97.875
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>144.608</b>	<b>–</b>	<b>168.977</b>	<b>6.203.856</b>	<b>16.611.479</b>	<b>751.111</b>	<b>23.880.031</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(694.713)	(694.713)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(4.735)	(4.735)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(699.448)</b>	<b>(699.448)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>144.608</b>	<b>–</b>	<b>168.977</b>	<b>6.203.856</b>	<b>16.611.479</b>	<b>51.663</b>	<b>23.180.583</b>

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.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle sind die geschätzten Auswirkungen eines Anstiegs der Zinssätze um 1 Basispunkt für die einzelnen Fonds, die ein Zinsrisiko tragen, dargestellt. 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 2022	30. Juni 2021
L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	18.992 £	15.741 £
L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	54.443 £	53.557 £
L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	19.983 \$	13.169 \$
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF	105.524 \$	177.247 \$
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF	5.227 £	7.363 £
L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	61.611 \$	67.849 \$
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	457.811 \$	274.891 \$
L&G ESG Green Bond UCITS ETF	6.726 €	19.696 €
L&G India INR Government Bond UCITS ETF <sup>1</sup>	178.629 \$	n. zutr.

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

Das bestehende Zinsrisiko wird für den L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF als nicht wesentlich erachtet, deshalb wird keine Sensitivitätsanalyse ausgewiesen.

##### 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 2021 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 ESG China CNY Bond UCITS ETF, der L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF, der L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF, der L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF, der L&G ESG Green Bond 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 Kreditrisiko 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 ihrer 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 ESG China CNY Bond UCITS ETF
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 %	-
	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>

	L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF	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 <sup>1</sup>
AAA	-	1,03 %	-	15,67 %	-
AA+	-	1,24 %	0,42 %	9,08 %	-
AA-	100,00 %	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 %	-	-
	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### B. Kreditrisiko (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021 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 ESG China CNY Bond UCITS ETF
AAA	–	0,78 %	–	–
AA+	1,84 %	0,90 %	–	–
AA-	8,45 %	3,47 %	3,36 %	–
AA-	0,52 %	2,42 %	3,84 %	–
A+	14,13 %	10,94 %	3,86 %	100,00 %
A-	9,74 %	13,27 %	4,77 %	–
A	17,03 %	14,60 %	5,96 %	–
BBB+	21,46 %	25,56 %	5,35 %	–
BBB-	6,40 %	3,68 %	11,32 %	–
BBB	10,88 %	16,12 %	15,05 %	–
BB+	–	–	0,96 %	–
BB-	–	–	9,54 %	–
BB	–	–	4,88 %	–
B+	–	–	6,62 %	–
B-	–	–	2,90 %	–
B	–	–	9,55 %	–
CCC+	–	–	1,92 %	–
CCC-	–	–	0,29 %	–
CC	–	–	0,06 %	–
Ohne Rating	9,55 %	8,26 %	9,77 %	–
	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>	<b>100,00 %</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### B. Kreditrisiko (Fortsetzung)

	L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF	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
AAA	–	1,08 %	–	21,45 %
AA+	–	1,97 %	0,31 %	2,39 %
AA-	–	4,83 %	2,81 %	4,97 %
AA-	100,00 %	1,06 %	0,46 %	15,66 %
A+	–	8,22 %	4,83 %	3,33 %
A-	–	20,68 %	7,07 %	11,66 %
A	–	9,90 %	4,98 %	4,54 %
BBB+	–	23,54 %	6,88 %	13,83 %
BBB-	–	9,84 %	11,29 %	2,81 %
BBB	–	16,15 %	6,38 %	9,01 %
BB+	–	0,80 %	5,91 %	–
BB-	–	0,45 %	8,35 %	1,14 %
BB	–	–	2,76 %	0,39 %
B+	–	–	3,23 %	–
B-	–	–	1,13 %	0,43 %
B	–	–	1,85 %	–
CCC+	–	–	1,59 %	0,42 %
CCC-	–	–	0,07 %	–
Ohne Rating	–	1,48 %	30,10 %	7,97 %
	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 (mit Ausnahme des L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF) 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 (mit Ausnahme des L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF) kann die Gesellschaft nach Ermessen des Unteraanlageverwalters 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.

Für den L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF werden Zeichnungen auf der Basis „frei Zahlung“ abgerechnet. Das mit der Abrechnung verbundene Risiko trägt jedoch der betreffende autorisierte Teilnehmer, da gemäß den Bedingungen des fondsspezifischen Nachtrags zum Verkaufsprospekt der Gesellschaft alle Zeichnungen vom autorisierten Teilnehmer „vorfinanziert“ sein müssen. Rücknahmen werden auf der Basis „Lieferung gegen Zahlung“ abgerechnet.

###### (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 Anteilrücknahmen 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 2022 und 30. Juni 2021 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 EMIR (European Market Infrastructure Regulation) 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Indizes nachbilden, sowie jeweils die entsprechenden Basisindizes:

Name des Fonds	Gehebelter Index	Basisindex
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	LevDAX® x2 Index	DAX® Index
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	FTSE 100® Daily Leveraged Index	FTSE 100® Net Dividend Total Return Index

Name des Fonds	Gehebelter inverser Index	Basisindex
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	ShortDAX® x2 Index	DAX® Index
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index	FTSE 100® Total Return Declared Dividend Index

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 2022 wie folgt:

L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	Verzinslich 3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	1.140.000	–	–	–	–	–	1.140.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	1.343.357	–	–	–	–	–	1.343.357
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	27.076.328	–	–	–	–	–	27.076.328
Ausstehende Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	1.515.591	1.515.591
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>29.559.685</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.515.591</b>	<b>31.075.276</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(2.098.885)	(2.098.885)
Kontokorrentverbindlichkeiten	(783)	–	–	–	–	–	(783)
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(950.000)	(950.000)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(16.339)	(16.339)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(783)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(3.065.224)</b>	<b>(3.066.007)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>29.558.902</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1.549.633)</b>	<b>28.009.269</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat</b>	<b>1-3 Monate</b>	<b>3 Monate bis zu 1 Jahr</b>	<b>1-5 Jahre</b>	<b>Mehr als 5 Jahre</b>	<b>Nicht verzinslich</b>	<b>Insgesamt</b>
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.360.795	–	–	–	–	–	1.360.795
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	2.929.038	–	–	–	–	–	2.929.038
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	2.851.623	2.851.623
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	36.774.800	–	–	–	–	–	36.774.800
Ausstehende Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	2.045.440	2.045.440
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	2.483	2.483
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>41.064.633</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.899.546</b>	<b>45.964.179</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(1.470.000)	–	–	–	–	–	(1.470.000)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(22.994)	(22.994)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(1.470.000)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(22.994)</b>	<b>(1.492.994)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>39.594.633</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.876.552</b>	<b>44.471.185</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>701.343.716</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.554.635</b>	<b>702.898.351</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
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)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(78.231)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(44.659.893)</b>	<b>(44.738.124)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>701.265.485</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(43.105.258)</b>	<b>658.160.227</b>

L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) 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
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Geldmarktinstrumente	2.573.265	–	–	–	–	–	2.573.265
- Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	278.323	278.323
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	16.159.757	–	–	–	–	–	16.159.757
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	3.870	3.870
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>18.733.022</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>282.193</b>	<b>19.015.215</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(1.050.000)	–	–	–	–	–	(1.050.000)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(17.210)	(17.210)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(1.050.000)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(17.210)</b>	<b>(1.067.210)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>17.683.022</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>264.983</b>	<b>17.948.005</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) 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
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	470.000	–	–	–	–	–	470.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	787.364	–	–	–	–	–	787.364
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	10.443.751	–	–	–	–	–	10.443.751
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	385	385
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>11.701.115</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>385</b>	<b>11.701.500</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
– Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(202.833)	(202.833)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(11.980)	(11.980)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(214.813)</b>	<b>(214.813)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>11.701.115</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(214.428)</b>	<b>11.486.687</b>

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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>31.726.969</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>10.587</b>	<b>31.737.556</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(869.132)	(869.132)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(18.614)	(18.614)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(887.746)</b>	<b>(887.746)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>31.726.969</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(877.159)</b>	<b>30.849.810</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

###### (iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G 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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	383	–	–	–	–	–	383
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	3.770.000	–	–	–	–	–	3.770.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	7.316.215	–	–	–	–	–	7.316.215
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	102.009.070	–	–	–	–	–	102.009.070
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	4.977	4.977
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>113.095.668</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.977</b>	<b>113.100.645</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(6.923.757)	(6.923.757)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(80.430)	(80.430)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(7.004.187)</b>	<b>(7.004.187)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>113.095.668</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(6.999.210)</b>	<b>106.096.458</b>
<b>L&amp;G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF<sup>1</sup></b>	<b>\$</b>	<b>\$</b>	<b>\$</b>	<b>\$</b>	<b>\$</b>	<b>\$</b>	<b>\$</b>
<b>Vermögenswerte</b>							
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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>897.273.330</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>74.562</b>	<b>897.347.892</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
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)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(40.368)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(58.544.940)</b>	<b>(58.585.308)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>897.232.962</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(58.470.378)</b>	<b>838.762.584</b>

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 2021 wie folgt:

L&G DAX® Daily 2x Long 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
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	290.108	–	–	–	–	–	290.108
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	1.813.614	–	–	–	–	–	1.813.614
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	24.266.328	–	–	–	–	–	24.266.328
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>26.370.050</b>	–	–	–	–	–	<b>26.370.050</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(290.000)	–	–	–	–	–	(290.000)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(247.816)	(247.816)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(12.919)	(12.919)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(290.000)</b>	–	–	–	–	<b>(260.735)</b>	<b>(550.735)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>26.080.050</b>	–	–	–	–	<b>(260.735)</b>	<b>25.819.315</b>

L&G DAX® Daily 2x Short 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
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	224	–	–	–	–	–	224
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	580.000	–	–	–	–	–	580.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	2.805.266	–	–	–	–	–	2.805.266
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	366.869	366.869
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	44.148.270	–	–	–	–	–	44.148.270
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	3.357	3.357
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>47.533.760</b>	–	–	–	–	<b>370.226</b>	<b>47.903.986</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(23.295)	(23.295)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	–	–	–	–	<b>(23.295)</b>	<b>(23.295)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>47.533.760</b>	–	–	–	–	<b>346.931</b>	<b>47.880.691</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	1.489.420	–	–	–	–	–	1.489.420
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	103.571.225	–	–	–	–	–	103.571.225
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	37.901.189	37.901.189
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	1.103.956.000	–	–	–	–	–	1.103.956.000
Ausstehende Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	1.857.377	1.857.377
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	47.859	47.859
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>1.209.016.645</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>39.806.425</b>	<b>1.248.823.070</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(20.500.000)	–	–	–	–	–	(20.500.000)
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(1.728.000)	(1.728.000)
Fällige Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	(1.481.924)	(1.481.924)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(356.066)	(356.066)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(20.500.000)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(3.565.990)</b>	<b>(24.065.990)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>1.188.516.645</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>36.240.435</b>	<b>1.224.757.080</b>

L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) 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
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	91	–	–	–	–	–	91
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	1.823.332	–	–	–	–	–	1.823.332
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	17.820.000	–	–	–	–	–	17.820.000
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	167	167
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>19.643.423</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>167</b>	<b>19.643.590</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(270.000)	–	–	–	–	–	(270.000)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(133.209)	(133.209)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(14.140)	(14.140)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(270.000)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(147.349)</b>	<b>(417.349)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>19.373.423</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(147.182)</b>	<b>19.226.241</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

##### (iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) 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
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	60.000	–	–	–	–	–	60.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	598.160	–	–	–	–	–	598.160
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	53.803	53.803
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	10.588.751	–	–	–	–	–	10.588.751
Ausstehende Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	1.225.632	1.225.632
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	100	100
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>11.246.911</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.279.535</b>	<b>12.526.446</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(6.370)	(6.370)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(6.370)</b>	<b>(6.370)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>11.246.911</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.273.165</b>	<b>12.520.076</b>

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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	1.679.894	–	–	–	–	–	1.679.894
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	2.926.984	–	–	–	–	–	2.926.984
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	36.548.923	–	–	–	–	–	36.548.923
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	12	12
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>41.155.801</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>12</b>	<b>41.155.813</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(841.962)	(841.962)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(12.427)	(12.427)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(854.389)</b>	<b>(854.389)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>41.155.801</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(854.377)</b>	<b>40.301.424</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

###### (iii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

L&G 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 verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	8.543.256	–	–	–	–	–	8.543.256
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	2.961.381	2.961.381
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	83.859.070	–	–	–	–	–	83.859.070
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	3.683	3.683
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>92.402.326</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.965.064</b>	<b>95.367.390</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Kontokorrentverbindlichkeiten	(2.731)	–	–	–	–	–	(2.731)
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(1.500.000)	–	–	–	–	–	(1.500.000)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(14.929)	(14.929)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(1.502.731)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(14.929)</b>	<b>(1.517.660)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>90.899.595</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.950.135</b>	<b>93.849.730</b>

L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock 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
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	1.134.629	–	–	–	–	–	1.134.629
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	350.603	350.603
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	10.061.553	–	–	–	–	–	10.061.553
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	422	422
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>11.196.182</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>351.025</b>	<b>11.547.207</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(160.017)	–	–	–	–	–	(160.017)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(3.243)	(3.243)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(160.017)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(3.243)</b>	<b>(163.260)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>11.036.165</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>347.782</b>	<b>11.383.947</b>

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

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

##### 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, Citigroup Global Markets Limited 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 207.068 US\$ für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (30. Juni 2021: 12.181 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 2022 und 30. Juni 2021 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, Citigroup Global Markets Limited 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 2021: A), für Citigroup Global Markets Limited ist A+ (30. Juni 2021: A+) und für Merrill Lynch International ist A+ (30. Juni 2021: AA+) .

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

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 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
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	<b>149.444.522 \$</b>	<b>1 %</b>	<b>98.891.208 \$</b>	<b>1 %</b>	<b>28.516.411 \$</b>	<b>0 %</b>	<b>1.465.649.316 \$</b>	<b>12 %</b>

Zum 30. Juni 2021 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 2021	% des Nettovermögens	Merrill Lynch International 30. Juni 2021	% des Nettovermögens	Citigroup Global Markets Limited 30. Juni 2021	% des Nettovermögens	Barclays Bank Plc 30. Juni 2021	% des Nettovermögens
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	<b>126.829.892 \$</b>	<b>1 %</b>	<b>120.463.147 \$</b>	<b>1 %</b>	<b>37.386.855 \$</b>	<b>0 %</b>	<b>1.216.929.779 \$</b>	<b>9 %</b>

##### (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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 2022 und 30. Juni 2021 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.

#### 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 2022 hielt kein Fonds mehr als 173 %\* (30. Juni 2021: 74 %\*) seines Nettovermögens in Kassenbeständen.

\* In diesen Beträgen sind als Sicherheiten gehaltene Barmittel nicht eingeschlossen.

In der nachfolgenden Tabelle werden zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesene finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten nach den vorstehend beschriebenen drei Ebenen analysiert:

#### Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

30. Juni 2022	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	\$				
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
		<b>8.324.773.346</b>	<b>3.522.923.923</b>	–	<b>11.847.697.269</b>
<b>L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		31.667.664	–	–	31.667.664
		<b>31.667.664</b>	–	–	<b>31.667.664</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF</b>	€				
Geldmarktinstrumente		1.343.357	–	–	1.343.357
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	27.076.328	–	27.076.328
		<b>1.343.357</b>	<b>27.076.328</b>	–	<b>28.419.685</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	€				
Geldmarktinstrumente		2.929.038	–	–	2.929.038
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	2.851.623	–	2.851.623
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	36.774.800	–	36.774.800
		<b>2.929.038</b>	<b>39.626.423</b>	–	<b>42.555.461</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		49.574.992	–	–	49.574.992
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	623.438.724	–	623.438.724
		<b>49.574.992</b>	<b>623.438.724</b>	–	<b>673.013.716</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Geldmarktinstrumente		2.573.265	–	–	2.573.265
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	278.323	–	278.323
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	16.159.757	–	16.159.757
		<b>2.573.265</b>	<b>16.438.080</b>	–	<b>19.011.345</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Geldmarktinstrumente		787.364	–	–	787.364
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	10.443.751	–	10.443.751
		<b>787.364</b>	<b>10.443.751</b>	–	<b>11.231.115</b>
<b>L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		33.728.032	–	–	33.728.032
		<b>33.728.032</b>	–	–	<b>33.728.032</b>
<b>L&amp;G Gold Mining UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		126.762.821	–	–	126.762.821
		<b>126.762.821</b>	–	–	<b>126.762.821</b>
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		2.341.426	–	–	2.341.426
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	29.294.923	–	29.294.923
		<b>2.341.426</b>	<b>29.294.923</b>	–	<b>31.636.349</b>
<b>L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		801.566.570	–	–	801.566.570
		<b>801.566.570</b>	–	–	<b>801.566.570</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
<b>L&amp;G Cyber Security UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		2.467.615.921	–	–	2.467.615.921
		<b>2.467.615.921</b>	–	–	<b>2.467.615.921</b>
<b>L&amp;G All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		7.316.215	–	–	7.316.215
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	102.009.070	–	102.009.070
		<b>7.316.215</b>	<b>102.009.070</b>	–	<b>109.325.285</b>
<b>L&amp;G Battery Value–Chain UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		743.728.921	–	–	743.728.921
Vorzugsaktien		28.658.071	–	–	28.658.071
		<b>772.386.992</b>	–	–	<b>772.386.992</b>
<b>L&amp;G Pharma Breakthrough UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		33.895.308	–	–	33.895.308
		<b>33.895.308</b>	–	–	<b>33.895.308</b>
<b>L&amp;G Ecommerce Logistics UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		262.471.950	–	–	262.471.950
		<b>262.471.950</b>	–	–	<b>262.471.950</b>
<b>L&amp;G US Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		385.283.834	–	–	385.283.834
		<b>385.283.834</b>	–	–	<b>385.283.834</b>
<b>L&amp;G UK Equity UCITS ETF</b>	£				
Stammaktien		45.112.420	–	–	45.112.420
		<b>45.112.420</b>	–	–	<b>45.112.420</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
<b>L&amp;G Japan Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		280.471.821	–	–	280.471.821
		<b>280.471.821</b>	–	–	<b>280.471.821</b>
<b>L&amp;G Global Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		55.805.305	–	–	55.805.305
Vorzugsaktien		87.951	–	–	87.951
Bezugsrechte		65	–	–	65
		<b>55.893.321</b>	–	–	<b>55.893.321</b>
<b>L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF</b>	€				
Stammaktien		192.791.111	–	–	192.791.111
Vorzugsaktien		1.909.728	–	–	1.909.728
		<b>194.700.839</b>	–	–	<b>194.700.839</b>
<b>L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		263.177.639	–	–	263.177.639
Unternehmensanleihen		–	30.020	–	30.020
		<b>263.177.639</b>	<b>30.020</b>	–	<b>263.207.659</b>
<b>L&amp;G Clean Water UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		307.702.167	–	–	307.702.167
		<b>307.702.167</b>	–	–	<b>307.702.167</b>
<b>L&amp;G Artificial Intelligence UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		223.201.822	–	–	223.201.822
		<b>223.201.822</b>	–	–	<b>223.201.822</b>
<b>L&amp;G Healthcare Breakthrough UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		125.029.978	–	–	125.029.978
		<b>125.029.978</b>	–	–	<b>125.029.978</b>
<b>L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF</b>	€				
Stammaktien		91.734.309	–	–	91.734.309
Vorzugsaktien		211.639	–	–	211.639
		<b>91.945.948</b>	–	–	<b>91.945.948</b>
<b>L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		858.878.729	–	–	858.878.729
		<b>858.878.729</b>	–	–	<b>858.878.729</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
<b>L&amp;G Clean Energy UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		175.089.299	–	–	175.089.299
Bezugsrechte		83.334	–	–	83.334
		<b>175.172.633</b>	–	–	<b>175.172.633</b>
<b>L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF</b>	£				
Unternehmensanleihen		–	68.259.120	–	68.259.120
		–	<b>68.259.120</b>	–	<b>68.259.120</b>
<b>L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF</b>	£				
Unternehmensanleihen		–	82.924.022	–	82.924.022
		–	<b>82.924.022</b>	–	<b>82.924.022</b>
<b>L&amp;G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF</b>	\$				
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten		–	3.203	–	3.203
Unternehmensanleihen		–	13.791.337	–	13.791.337
Staatsanleihe		–	64.543.497	–	64.543.497
		–	<b>78.338.037</b>	–	<b>78.338.037</b>
<b>L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF</b>	\$				
Staatsanleihe		–	255.069.539	–	255.069.539
		–	<b>255.069.539</b>	–	<b>255.069.539</b>
<b>L&amp;G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF</b>	£				
Staatsanleihe		–	21.554.315	–	21.554.315
		–	<b>21.554.315</b>	–	<b>21.554.315</b>
<b>L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF</b>	\$				
Unternehmensanleihen		–	90.144.147	–	90.144.147
		–	<b>90.144.147</b>	–	<b>90.144.147</b>
<b>L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF</b>	\$				
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten		–	381.052	–	381.052
Unternehmensanleihen		–	937.925.050	–	937.925.050
Staatsanleihe		–	12.930.976	–	12.930.976
		–	<b>951.237.078</b>	–	<b>951.237.078</b>
<b>L&amp;G Hydrogen Economy UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		495.194.006	–	–	495.194.006
		<b>495.194.006</b>	–	–	<b>495.194.006</b>
<b>L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF</b>	€				
Unternehmensanleihen		–	5.350.143	–	5.350.143
Staatsanleihe		–	2.763.890	–	2.763.890
		–	<b>8.114.033</b>	–	<b>8.114.033</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF</b>	£				
Stammaktien		42.591.242	–	–	42.591.242
		<b>42.591.242</b>	–	–	<b>42.591.242</b>
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF</b>	€				
Stammaktien		20.659.302	–	–	20.659.302
Vorzugsaktien		576.330	–	–	576.330
		<b>21.235.632</b>	–	–	<b>21.235.632</b>
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		19.988.531	–	–	19.988.531
Vorzugsaktien		991.608	–	–	991.608
		<b>20.980.139</b>	–	–	<b>20.980.139</b>
<b>L&amp;G Digital Payments UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		11.538.881	–	–	11.538.881
		<b>11.538.881</b>	–	–	<b>11.538.881</b>
<b>L&amp;G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF<sup>1</sup></b>	\$				
Geldmarktinstrumente		80.360.375	–	–	80.360.375
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	795.902.955	–	795.902.955
		<b>80.360.375</b>	<b>795.902.955</b>	–	<b>876.263.330</b>
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF<sup>2</sup></b>	\$				
Stammaktien		15.086.890	–	–	15.086.890
Vorzugsaktien		537.134	–	–	537.134
		<b>15.624.024</b>	–	–	<b>15.624.024</b>
<b>L&amp;G India INR Government Bond UCITS ETF<sup>3</sup></b>	\$				
Staatsanleihe		–	276.814.385	–	276.814.385
		–	<b>276.814.385</b>	–	<b>276.814.385</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>2</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>3</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2021	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		124.998.774	–	–	124.998.774
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	41.722.568	–	41.722.568
Stammaktien		10.023.971.107	–	43.875	10.024.014.982
Bezugsrechte		15.224	–	–	15.224
Unternehmensanleihen		–	859.481.634	–	859.481.634
Staatsanleihe		–	514.523.210	–	514.523.210
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	1.354.803.398	–	1.354.803.398
		<b>10.148.985.105</b>	<b>2.770.530.810</b>	<b>43.875</b>	<b>12.919.559.790</b>
<b>L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		42.304.097	–	43.875	42.347.972
		<b>42.304.097</b>	<b>–</b>	<b>43.875</b>	<b>42.347.972</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF</b>	€				
Geldmarktinstrumente		1.813.614	–	–	1.813.614
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	24.266.328	–	24.266.328
		<b>1.813.614</b>	<b>24.266.328</b>	<b>–</b>	<b>26.079.942</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	€				
Geldmarktinstrumente		2.805.266	–	–	2.805.266
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	366.869	–	366.869
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	44.148.270	–	44.148.270
		<b>2.805.266</b>	<b>44.515.139</b>	<b>–</b>	<b>47.320.405</b>
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		103.571.225	–	–	103.571.225
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	37.901.189	–	37.901.189
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	1.103.956.000	–	1.103.956.000
		<b>103.571.225</b>	<b>1.141.857.189</b>	<b>–</b>	<b>1.245.428.414</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Geldmarktinstrumente		1.823.332	–	–	1.823.332
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	17.820.000	–	17.820.000
		<b>1.823.332</b>	<b>17.820.000</b>	<b>–</b>	<b>19.643.332</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Geldmarktinstrumente		598.160	–	–	598.160
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	53.803	–	53.803
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	10.588.751	–	10.588.751
		<b>598.160</b>	<b>10.642.554</b>	<b>–</b>	<b>11.240.714</b>
<b>L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		38.710.047	–	–	38.710.047
		<b>38.710.047</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>38.710.047</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2021	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>L&amp;G Gold Mining UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		155.213.214	–	–	155.213.214
		<b>155.213.214</b>	–	–	<b>155.213.214</b>
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		2.926.984	–	–	2.926.984
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	36.548.923	–	36.548.923
		<b>2.926.984</b>	<b>36.548.923</b>	–	<b>39.475.907</b>
<b>L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		1.252.893.177	–	–	1.252.893.177
		<b>1.252.893.177</b>	–	–	<b>1.252.893.177</b>
<b>L&amp;G Cyber Security UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		2.788.358.945	–	–	2.788.358.945
		<b>2.788.358.945</b>	–	–	<b>2.788.358.945</b>
<b>L&amp;G All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		8.543.256	–	–	8.543.256
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	2.961.381	–	2.961.381
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	83.859.070	–	83.859.070
		<b>8.543.256</b>	<b>86.820.451</b>	–	<b>95.363.707</b>
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		1.134.629	–	–	1.134.629
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	350.603	–	350.603
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	10.061.553	–	10.061.553
		<b>1.134.629</b>	<b>10.412.156</b>	–	<b>11.546.785</b>
<b>L&amp;G Battery Value–Chain UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		832.509.597	–	–	832.509.597
		<b>832.509.597</b>	–	–	<b>832.509.597</b>
<b>L&amp;G Pharma Breakthrough UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		34.270.643	–	–	34.270.643
		<b>34.270.643</b>	–	–	<b>34.270.643</b>
<b>L&amp;G Ecommerce Logistics UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		610.390.357	–	–	610.390.357
		<b>610.390.357</b>	–	–	<b>610.390.357</b>
<b>L&amp;G US Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		295.165.887	–	–	295.165.887
		<b>295.165.887</b>	–	–	<b>295.165.887</b>
<b>L&amp;G UK Equity UCITS ETF</b>	£				
Stammaktien		16.601.989	–	–	16.601.989
		<b>16.601.989</b>	–	–	<b>16.601.989</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2021	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>L&amp;G Japan Equity UCITS ETF</b>					
	\$				
Stammaktien		251.110.148	–	–	251.110.148
		<b>251.110.148</b>	–	–	<b>251.110.148</b>
<b>L&amp;G Global Equity UCITS ETF</b>					
	\$				
Stammaktien		51.244.631	–	–	51.244.631
Bezugsrechte		190	–	–	190
		<b>51.244.821</b>	–	–	<b>51.244.821</b>
<b>L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF</b>					
	€				
Stammaktien		112.861.207	–	–	112.861.207
Bezugsrechte		4.269	–	–	4.269
		<b>112.865.476</b>	–	–	<b>112.865.476</b>
<b>L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF</b>					
	\$				
Stammaktien		172.655.619	–	–	172.655.619
Bezugsrechte		1.718	–	–	1.718
Unternehmensanleihen		–	31.158	–	31.158
		<b>172.657.337</b>	<b>31.158</b>	–	<b>172.688.495</b>
<b>L&amp;G Clean Water UCITS ETF</b>					
	\$				
Stammaktien		231.554.039	–	–	231.554.039
		<b>231.554.039</b>	–	–	<b>231.554.039</b>
<b>L&amp;G Artificial Intelligence UCITS ETF</b>					
	\$				
Stammaktien		255.249.690	–	–	255.249.690
		<b>255.249.690</b>	–	–	<b>255.249.690</b>
<b>L&amp;G Healthcare Breakthrough UCITS ETF</b>					
	\$				
Stammaktien		219.066.567	–	–	219.066.567
		<b>219.066.567</b>	–	–	<b>219.066.567</b>
<b>L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF</b>					
	€				
Stammaktien		233.614.949	–	–	233.614.949
Bezugsrechte		6.960	–	–	6.960
		<b>233.621.909</b>	–	–	<b>233.621.909</b>
<b>L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF</b>					
	\$				
Stammaktien		1.703.516.278	–	–	1.703.516.278
		<b>1.703.516.278</b>	–	–	<b>1.703.516.278</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2021	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>L&amp;G Clean Energy UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		115.077.930	–	–	115.077.930
		<b>115.077.930</b>	–	–	<b>115.077.930</b>
<b>L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF</b>	£				
Unternehmensanleihen		–	59.438.850	–	59.438.850
		–	<b>59.438.850</b>	–	<b>59.438.850</b>
<b>L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF</b>	£				
Unternehmensanleihen		–	66.552.915	–	66.552.915
		–	<b>66.552.915</b>	–	<b>66.552.915</b>
<b>L&amp;G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF</b>	\$				
Unternehmensanleihen		–	6.773.065	–	6.773.065
Staatsanleihe		–	42.485.606	–	42.485.606
		–	<b>49.258.671</b>	–	<b>49.258.671</b>
<b>L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF</b>	\$				
Staatsanleihe		–	420.684.390	–	420.684.390
		–	<b>420.684.390</b>	–	<b>420.684.390</b>
<b>L&amp;G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF</b>	£				
Staatsanleihe		–	28.207.803	–	28.207.803
		–	<b>28.207.803</b>	–	<b>28.207.803</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2021	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF</b>	\$				
Unternehmensanleihen		–	91.799.714	–	91.799.714
		–	<b>91.799.714</b>	–	<b>91.799.714</b>
<b>L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF</b>	\$				
Unternehmensanleihen		–	568.697.420	–	568.697.420
Staatsanleihe		–	3.257.500	–	3.257.500
		–	<b>571.954.920</b>	–	<b>571.954.920</b>
<b>L&amp;G Hydrogen Economy UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		459.443.397	–	–	459.443.397
		<b>459.443.397</b>	–	–	<b>459.443.397</b>
<b>L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF</b>	€				
Unternehmensanleihen		–	15.287.139	–	15.287.139
Staatsanleihe		–	7.697.173	–	7.697.173
		–	<b>22.984.312</b>	–	<b>22.984.312</b>
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF</b>	£				
Stammaktien		26.267.797	–	–	26.267.797
		<b>26.267.797</b>	–	–	<b>26.267.797</b>
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF</b>	€				
Stammaktien		16.171.246	–	–	16.171.246
		<b>16.171.246</b>	–	–	<b>16.171.246</b>
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		19.686.569	–	–	19.686.569
		<b>19.686.569</b>	–	–	<b>19.686.569</b>
<b>L&amp;G Digital Payments UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		6.265.782	–	–	6.265.782
		<b>6.265.782</b>	–	–	<b>6.265.782</b>

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

30. Juni 2022	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>Gesellschaft insgesamt</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(112.121.180)	–	(112.121.180)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten		–	(8.317.825)	–	(8.317.825)
		–	<b>(120.439.005)</b>	–	<b>(120.439.005)</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF</b>	€				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(2.098.885)	–	(2.098.885)
		–	<b>(2.098.885)</b>	–	<b>(2.098.885)</b>
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(44.009.038)	–	(44.009.038)
		–	<b>(44.009.038)</b>	–	<b>(44.009.038)</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(202.833)	–	(202.833)
		–	<b>(202.833)</b>	–	<b>(202.833)</b>
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(869.132)	–	(869.132)
		–	<b>(869.132)</b>	–	<b>(869.132)</b>
<b>L&amp;G All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(6.923.757)	–	(6.923.757)
		–	<b>(6.923.757)</b>	–	<b>(6.923.757)</b>
<b>L&amp;G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten		–	(230.420)	–	(230.420)
		–	<b>(230.420)</b>	–	<b>(230.420)</b>
<b>L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten		–	(8.087.405)	–	(8.087.405)
		–	<b>(8.087.405)</b>	–	<b>(8.087.405)</b>
<b>L&amp;G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF<sup>1</sup></b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(57.878.638)	–	(57.878.638)
		–	<b>(57.878.638)</b>	–	<b>(57.878.638)</b>

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

30. Juni 2021	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>Summe Gesellschaft</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(1.319.868)	–	(1.319.868)
		–	<b>(1.319.868)</b>	–	<b>(1.319.868)</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	€				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(247.816)	–	(247.816)
		–	<b>(247.816)</b>	–	<b>(247.816)</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(133.209)	–	(133.209)
		–	<b>(133.209)</b>	–	<b>(133.209)</b>
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(841.962)	–	(841.962)
		–	<b>(841.962)</b>	–	<b>(841.962)</b>

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 E Fund MSCI China A UCITS ETF 30. Juni 2022	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	43.875	43.875
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	–	–
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	(43.875)	(43.875)
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Realisierter Gewinn	–	–
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	–	–
<b>Schlussbestand</b>	–	–

L&G UK Equity UCITS ETF 30. Juni 2022	Stammaktien £	Gesamt £
Anfangsbestand	–	–
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	30.482	30.482
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	–	–
Käufe	14.792	14.792
Verkäufe	(22.890)	(22.890)
Realisierter Gewinn	2.517	2.517
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(24.901)	(24.901)
<b>Schlussbestand</b>	–	–

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

L&G Global Equity UCITS ETF 30. Juni 2022	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	-	-
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	7.443	7.443
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	1.877	1.877
Verkäufe	-	-
Realisierter Gewinn	-	-
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(9.320)	(9.320)
<b>Schlussbestand</b>	-	-

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF 30. Juni 2022	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	-	-
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	1.132.160	1.132.160
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	334.792	334.792
Verkäufe	-	-
Realisierter Gewinn	-	-
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(1.466.952)	(1.466.952)
<b>Schlussbestand</b>	-	-

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF 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	-	-
<b>Schlussbestand</b>	-	-

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)
<b>Schlussbestand</b>	-	-

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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)
<b>Schlussbestand</b>	-	-

L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>1</sup> 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)
<b>Schlussbestand</b>	-	-

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF 30. Juni 2021	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	41.222	41.222
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	43.657	43.657
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	(41.222)	(41.222)
Käufe	27.357	27.357
Verkäufe	(14.227)	(14.227)
Realisierter Gewinn	412	412
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(13.324)	(13.324)
<b>Schlussbestand</b>	<b>43.875</b>	<b>43.875</b>

L&G UK Equity UCITS ETF 30. Juni 2021	Stammaktien £	Gesamt £
Anfangsbestand	6.175	6.175
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	-	-
Verkäufe	-	-
Realisierter Verlust	-	-
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(6.175)	(6.175)
<b>Schlussbestand</b>	-	-

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

L&G Global Equity UCITS ETF 30. Juni 2021	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	17.662	17.662
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	(15.818)	(15.818)
Käufe	-	-
Verkäufe	-	-
Realisierter Verlust	-	-
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(1.844)	(1.844)
<b>Schlussbestand</b>	-	-

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF 30. Juni 2021	Stammaktien US\$	Unternehmensanleihen US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	125.915	29.799	155.714
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	(125.915)	(29.799)	(155.714)
Käufe	-	-	-
Verkäufe	-	-	-
Realisierter Verlust	-	-	-
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes)	-	-	-
<b>Schlussbestand</b>	-	-	-

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF 30. Juni 2021	Stammaktien €	Gesamt €
Anfangsbestand	24.797	24.797
Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1	-	-
Käufe	-	-
Verkäufe	-	-
Realisierter Verlust	-	-
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes)	(24.797)	(24.797)
<b>Schlussbestand</b>	-	-

Alle realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste sind in der Gesamtergebnisrechnung offengelegt.

#### Osteuropa

Am 24. Februar 2022 startete Russlands 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 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.

Zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 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 UK Equity UCITS ETF, L&G Global Equity UCITS ETF, den L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF, den L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) 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 2022 Wertpapiere der Ebene 3 zum beizulegenden Zeitwert von null erfasst.

Für den L&G UK Equity UCITS ETF, den L&G Global Equity UCITS ETF und den L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere der Ebene 3 zum beizulegenden Zeitwert von null erfasst.

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2022 bzw. 30. Juni 2021 fanden Übertragungen von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten zwischen den verschiedenen Ebenen der Zeitwerthierarchie statt. 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 2021 der Ebene 3 der Zeitwerthierarchie zugeordnet waren.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

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.

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	30. Juni 2021
<b>Anlage</b>	<b>Stammaktien</b>
Zeitwert (US\$)	43.875
Hauptbewertungstechniken	Zuletzt gehandelter Preis
Wert bei Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	1.069.544
NIW je Anteil vor Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	0,8651
NIW je Anteil nach Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	0,8650
Auswirkung der Anwendung des Abschlags bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern auf den NIW je Anteil	(0,0104) %

Für den L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF wird zum 30. Juni 2022 keine Tabelle aufgeführt, da die im Vorjahr in Ebene 3 eingestufteten Wertpapiere zu Beginn des Geschäftsjahres in Ebene 1 übertragen wurden.

### 5. Derivaterisiko

#### 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.

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. ETF VaR 1D represents the daily volatility of the Fund's NAV over the course of

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

#### 5. Derivaterisiko (Fortsetzung)

##### B. VaR (Fortsetzung)

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 nachstehende Tabelle weist den relativen VaR für die einzelnen Fonds zum 30. Juni 2022 aus, berechnet mit einem Konfidenzniveau von 99 Prozent. Die Mindest-, Durchschnitts- und Höchstausnutzung 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 DAX® Daily 2x Long UCITS ETF*	6,24 %	13,96 %	27,92 %	99,86 %	99,88 %	99,91 %	LevDAX® x2 Index	3,13 %	6,99 %	13,98 %	262
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF*	6,24 %	13,95 %	27,91 %	99,83 %	99,86 %	99,89 %	ShortDAX® x2 Index	3,13 %	6,99 %	13,98 %	262
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 FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF*	4,61 %	10,30 %	20,61 %	99,76 %	99,81 %	99,84 %	FTSE 100® Daily Leveraged Index	2,31 %	5,16 %	10,33 %	262
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF*	4,61 %	10,31 %	20,62 %	99,84 %	99,89 %	99,92 %	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index	2,31 %	5,16 %	10,33 %	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 All Commodities UCITS ETF	2,97 %	6,63 %	13,26 %	50,00 %	50,02 %	50,04 %	Bloomberg Commodity Index Total Return	2,97 %	6,63 %	13,26 %	262
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>	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.

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 weist den relativen VaR für die einzelnen Fonds zum 30. Juni 2021 aus, berechnet mit einem Konfidenzniveau von 99 Prozent. Die Mindest-, Durchschnitts- und Höchstausnutzung der VaR-Limits im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 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 DAX® Daily 2x Long UCITS ETF*	5,34 %	11,93 %	23,86 %	99,86 %	99,86 %	99,87 %	LevDAX® x2 Index	2,67 %	5,97 %	11,95 %	262
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF*	5,34 %	11,94 %	23,87 %	99,85 %	99,86 %	99,91 %	ShortDAX® x2 Index	2,67 %	5,97 %	11,95 %	262
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	1,76 %	3,93 %	7,86 %	49,26 %	49,93 %	50,02 %	Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return	1,78 %	3,99 %	7,98 %	262
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF*	4,81 %	10,76 %	21,53 %	99,80 %	99,81 %	99,82 %	FTSE 100® Daily Leveraged Index	2,41 %	5,39 %	10,78 %	262
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF*	4,82 %	10,77 %	21,55 %	99,86 %	99,86 %	99,89 %	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index	2,41 %	5,39 %	10,78 %	262
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	5,43 %	12,15 %	24,29 %	50,89 %	50,98 %	51,37 %	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR	5,33 %	11,92 %	23,84 %	262
L&G All Commodities UCITS ETF	1,89 %	4,22 %	8,44 %	50,02 %	50,03 %	50,05 %	Bloomberg Commodity Index Total Return	1,89 %	4,22 %	8,43 %	262
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	2,07 %	4,63 %	9,26 %	50,00 %	50,00 %	50,01 %	Bloomberg ex-Agriculture and Livestock 15/30 Capped 3 Month Forward Total Return Index	2,07 %	4,63 %	9,26 %	262

\* Für diese Fonds wurde die nicht gehebelte Version des VaR verwendet.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 2022 und zum 30. Juni 2021 unterlagen die in der Tabelle auf den Seiten 209 bis 214 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (Fortsetzung)

Die folgenden Tabellen weisen 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 Barsicherheiten*	
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>						
	<b>OTC-Swaps</b>						
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Merrill Lynch International	2.851.623 €	-	2.851.623 €	-	(1.470.000) €	1.381.623 €
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	278.323 £	-	278.323 £	-	(278.323) £	-

\* 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (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*	
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>						
	<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>						
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Merrill Lynch International	27.076.328 €	-	27.076.328 €	-	(26.798.895) €	277.433 €
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Merrill Lynch International	36.774.800 €	-	36.774.800 €	-	(36.774.800) €	-
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	623.438.724 \$	-	623.438.724 \$	-	(623.438.724) \$	-
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	16.159.757 £	-	16.159.757 £	-	(16.159.757) £	-
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	10.443.751 £	-	10.443.751 £	-	(10.404.256) £	39.495 £
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	29.294.923 \$	-	29.294.923 \$	-	(29.294.923) \$	-
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	102.009.070 \$	-	102.009.070 \$	-	(102.009.070) \$	-
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>	Barclays Bank Plc	795.902.955 \$	-	795.902.955 \$	-	(795.902.955) \$	-

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

\* 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (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*	
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>						
	<b>OTC-Swaps</b>						
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Merrill Lynch International	2.098.885 €	-	2.098.885 €	-	(1.140.000) €	(958.885) €
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 FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	202.833 £	-	202.833 £	-	(202.833) £	-
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	869.132 \$	-	869.132 \$	-	(90.620) \$	(778.512) \$
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	6.923.757 \$	-	6.923.757 \$	-	(3.770.000) \$	(3.153.757) \$
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>	Barclays Bank Plc	57.878.638 \$	-	57.878.638 \$	-	(21.010.000) \$	(36.868.638) \$

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

\* 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (Fortsetzung)

Die folgenden Tabellen weisen die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 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*	
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>						
	<b>OTC-Swaps</b>						
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Merrill Lynch International	366.869 €	-	366.869 €	-	-	366.869 €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	37.901.189 \$	-	37.901.189 \$	-	(20.500.000) \$	17.401.189 \$
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	53.803 £	-	53.803 £	-	-	53.803 £
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	2.961.381 \$	-	2.961.381 \$	-	(1.500.000) \$	1.461.381 \$
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	Barclays Bank Plc	350.603 \$	-	350.603 \$	-	(160.017) \$	190.586 \$

\* 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (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*	
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>						
	<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>						
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Merrill Lynch International	24.266.328 €	-	24.266.328 €	-	(24.266.328) €	-
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Merrill Lynch International	44.148.270 €	-	44.148.270 €	-	(43.641.515) €	506.755 €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	1.103.956.000 \$	-	1.103.956.000 \$	-	(1.103.956.000) \$	-
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	17.820.000 £	-	17.820.000 £	-	(17.820.000) £	-
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	10.588.751 £	-	10.588.751 £	-	(10.567.630) £	21.121 £
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	36.548.923 \$	-	36.548.923 \$	-	(36.548.923) \$	-
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	83.859.070 \$	-	83.859.070 \$	-	(83.859.070) \$	-
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	Barclays Bank Plc	10.061.553 \$	-	10.061.553 \$	-	(10.061.553) \$	-

\* 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 13. Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträgen oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen (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*	
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>						
	<b>OTC-Swaps</b>						
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Merrill Lynch International	247.816 €	-	247.816 €	-	-	247.816 €
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Merrill Lynch International	133.209 £	-	133.209 £	-	-	133.209 £
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	841.962 \$	-	841.962 \$	-	(841.962) \$	-

\* 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Anteilklassen 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 2022 und 30. Juni 2021 zahlten die folgenden Fonds die folgenden Ausschüttungen:

Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022		Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	
	Ex-Tag	Dividendensatz	Ex-Tag	Dividendensatz
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>				
USD Distributing ETF	9. September 2021	0,0787 \$	17. September 2020	0,1420 \$
	9. Dezember 2021	0,0819 \$	17. Dezember 2020	0,0240 \$
	10. März 2022	0,0767 \$	11. März 2021	0,0798 \$
	9. Juni 2022	0,0870 \$	10. Juni 2021	0,0805 \$
<b>L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF</b>				
GBP Distributing ETF	15. Juli 2021	0,0321 £	-	-
	13. Januar 2022	0,0425 £	-	-
<b>L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF</b>				
GBP Distributing ETF	15. Juli 2021	0,0849 £	-	-
	13. Januar 2022	0,0808 £	-	-
<b>L&amp;G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF</b>				
USD Distributing ETF	15. Juli 2021	0,1238 \$	-	-
	13. Januar 2022	0,1191 \$	-	-
<b>L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF</b>				
EUR Hedged Distributing ETF	13. Januar 2022	0,1314 €	-	-
USD Distributing ETF	15. Juli 2021	0,1534 \$	-	-
USD Distributing ETF	13. Januar 2022	0,1442 \$	-	-
<b>L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF</b>				
USD Distributing ETF	15. Juli 2021	0,0769 \$	-	-
	13. Januar 2022	0,0947 \$	-	-
<b>L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF</b>				
GBP Hedged Distributing ETF	13. Januar 2022	0,0176 £	-	-
USD Distributing ETF	15. Juli 2021	0,1168 \$	-	-
USD Distributing ETF	13. Januar 2022	0,1529 \$	-	-

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 14. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile (Fortsetzung)

Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022		Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	
	Ex-Tag	Dividendensatz	Ex-Tag	Dividendensatz
<b>L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF</b>				
EUR Distributing ETF	15. Juli 2021	0,011 €	-	-
EUR Distributing ETF	13. Januar 2022	0,0197 €	-	-
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF</b>				
GBP Distributing ETF	9. September 2021	0,2790 £	-	-
	9. Dezember 2021	0,0840 £	-	-
	10. März 2022	0,0833 £	-	-
	9. Juni 2022	0,1925 £	10. Juni 2021	0,0884 £
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF</b>				
EUR Distributing ETF	9. September 2021	0,0626 €	-	-
EUR Distributing ETF	9. Dezember 2021	0,0990 €	-	-
EUR Distributing ETF	10. März 2022	0,0150 €	-	-
EUR Distributing ETF	9. Juni 2022	0,3014 €	10. Juni 2021	0,1489 €
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF</b>				
USD Distributing ETF	9. September 2021	0,0945 \$	-	-
USD Distributing ETF	9. Dezember 2021	0,0662 \$	-	-
USD Distributing ETF	10. März 2022	0,1314 \$	-	-
USD Distributing ETF	9. Juni 2022	0,1129 \$	10. Juni 2021	0,0571 \$
<b>L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF<sup>1</sup></b>				
USD Distributing ETF	9. September 2021	0,1073 \$	n. zutr.	n. zutr.
USD Distributing ETF	9. Dezember 2021	0,0434 \$	n. zutr.	n. zutr.
USD Distributing ETF	10. März 2022	0,0324 \$	n. zutr.	n. zutr.
USD Distributing ETF	9. Juni 2022	0,1019 \$	n. zutr.	n. zutr.
<b>L&amp;G India INR Government Bond UCITS ETF<sup>2</sup></b>				
USD Distributing ETF	13. Januar 2022	0,0946 \$	n. zutr.	n. zutr.

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>2</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

Während der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 wurden für den L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF keine Ausschüttungen vorgenommen.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 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.

#### 16. Nettoinventarwert

Die folgende Tabelle fasst den NIW, die in Umlauf befindlichen Anteile und den NIW je Anteil am Ende der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2022, 30. Juni 2021 und 30. Juni 2020 zusammen.

Fonds / Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2022 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2022 Je Anteil
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	31.978.263	1.680.000	19,0347
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	28.009.269	113.465	246,8538
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	44.471.185	20.437.015	2,1760
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	658.160.227	28.768.433	22,8779
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	17.948.005	59.077	303,8070
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	11.486.687	2.722.684	4,2189
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	33.921.199	437.767	77,4869
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 All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	106.096.458	7.218.910	14,6970
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 US Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	385.777.452	26.748.734	14,4223
L&G UK Equity UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	45.243.834	3.940.000	11,4832
L&G Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	282.173.048	27.055.000	10,4296
L&G Global Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	56.028.143	4.200.000	13,3400
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	194.967.107	15.807.165	12,3341
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	263.868.735	22.815.064	11,5655
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	309.086.103	23.950.000	12,9055

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	92.121.663	7.843.647	11,7447
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	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 <sup>1</sup>	EUR	6.406.121	660.000	9,7062
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	178.181.981	17.550.609	10,1525
L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF - EUR Hedged Distributing ETF <sup>2</sup>	EUR	76.850.171	6.896.085	11,1440
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	21.649.346	2.250.000	9,6219
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 <sup>3</sup>	EUR	174.403.942	20.588.941	8,4708
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Accumulating ETF <sup>3</sup>	CHF	378.580.948	44.715.497	8,4664
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - GBP Hedged Distributing ETF <sup>3</sup>	GBP	4.449.806	513.137	8,6718
L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF - CHF Hedged Distributing ETF <sup>4</sup>	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	EUR	8.143.600	960.239	8,4808
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	43.105.616	4.603.736	9,3632
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 <sup>5</sup>	US\$	838.762.584	60.021.282	13,9744
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>6</sup>	US\$	15.856.377	1.900.000	8,3455
L&G India INR Government Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF <sup>7</sup>	US\$	279.367.171	30.300.000	9,2200

<sup>1</sup>Die Anteilklasse wurde am 6. Mai 2022 aufgelegt.

<sup>2</sup>Die Anteilklasse wurde am 21. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>3</sup>Die Anteilklasse wurde am 20. August 2021 aufgelegt.

<sup>4</sup>Die Anteilklasse wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

<sup>5</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>6</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>7</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 16. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2021	Anteile im Umlauf	NIW je Anteil zum 30. Juni 2021
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	43.889.334	1.980.000	22,1663
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	25.819.315	67.009	385,3111
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	47.880.691	27.458.366	1,7437
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	1.224.757.080	68.302.602	17,9313
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	19.226.241	67.231	285,9728
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	12.520.076	2.451.608	5,1068
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	38.826.713	392.767	98,8543
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 All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	93.849.730	7.920.310	11,8492
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 US Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	295.471.416	17.803.271	16,5964
L&G UK Equity UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	16.662.712	1.540.000	10,8199
L&G Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	252.730.395	19.445.000	12,9971
L&G Global Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	51.392.796	3.300.000	15,5735
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	113.087.160	8.180.988	13,8231
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	173.891.675	12.696.064	13,6965
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 Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	233.988.889	17.965.798	13,0241
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	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 ESG China CNY Bond UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	427.341.761	41.100.000	10,3976
L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	28.356.001	2.850.000	9,9494
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	EUR	23.180.583	2.350.000	9,864

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

### 16. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

Fonds/Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2021	Anteile im Umlauf	NIW je Anteil zum 30. Juni 2021
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF - GBP Distributing ETF	GBP	26.452.836	2.600.000	10,1741
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

Fonds/Anteilklasse	Währung	NIW zum 30. Juni 2020 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW je Anteil zum 30. Juni 2020 Je Anteil
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	27.517.011	1.730.000	15,9057
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	30.354.290	120.209	252,5126
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	67.772.133	21.633.366	3,1327
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	439.243.546	36.093.787	12,1695
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	12.487.709	57.885	215,733
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	26.073.456	3.349.704	7,7838
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	48.856.605	803.767	60,7845
L&G Gold Mining UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	273.800.641	7.562.093	36,2069
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF - USD Distributing ETF	US\$	13.578.782	4.911.066	2,7649
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	816.606.435	47.430.616	17,2168
L&G Cyber Security UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	1.547.753.663	81.536.776	18,9822
L&G All Commodities UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	50.460.470	6.191.310	8,1502
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	7.801.655	791.187	9,8606
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	111.264.445	12.150.000	9,1575
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	25.643.912	2.150.000	11,9274
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	58.987.801	5.550.000	10,6284
L&G US Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	137.286.308	11.767.267	11,6667
L&G UK Equity UCITS ETF - GBP Accumulating ETF	GBP	10.962.695	1.200.000	9,1355
L&G Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	116.469.371	11.185.000	10,4129
L&G Global Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	32.552.079	2.900.000	11,2248
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	99.876.259	9.360.988	10,6694
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	47.377.214	4.605.639	10,2867
L&G Clean Water UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	15.520.613	1.500.000	10,3470
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	82.834.267	6.496.000	12,7515
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	33.256.148	2.650.000	12,5494
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - EUR Accumulating ETF	EUR	92.898.894	9.200.000	10,0977
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF - USD Accumulating ETF	US\$	602.438.807	57.400.000	10,4954

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 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 2022						
Nettoertrag nach Segmenten*	(192.843.109)	(1.562.394.319)	75.891.276	(237.780.540)	(419.003.968)	(2.336.130.660)

	Vereinigtes Königreich	Rest Europas	Vereinigte Staaten	Japan	Rest der Welt	Gesellschaft insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021						
Nettoertrag nach Segmenten*	39.911.235	2.117.582.285	36.471.892	126.042.780	295.185.955	2.615.194.147

\* Stellt die Erträge insgesamt abzüglich Zinsaufwendungen dar

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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.

Am 20. April 2020 erfolgte in der Gesellschaft die Umstellung auf das Abwicklungsmodell International Central Securities Depository (ICSD). 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 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 Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (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 weist die Transaktionskosten für die Fonds mit Anlagen in Stammaktien für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 detailliert aus.

	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2022	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2021
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	33.393 \$	128.635 \$
L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF	3.508 \$	3.327 \$
L&G Gold Mining UCITS ETF	61.654 \$	139.170 \$
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	388.983 \$	515.018 \$
L&G Cyber Security UCITS ETF	2.347.962 \$	1.246.819 \$
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	602.949 \$	620.870 \$
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	23.447 \$	24.011 \$
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	411.379 \$	385.108 \$
L&G US Equity UCITS ETF	16.175 \$	5.004 \$
L&G UK Equity UCITS ETF	139.857 £	22.647 £
L&G Japan Equity UCITS ETF	17.666 \$	10.912 \$
L&G Global Equity UCITS ETF	7.637 \$	3.710 \$
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	99.578 €	39.203 €
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	109.228 \$	49.443 \$
L&G Clean Water UCITS ETF	206.394 \$	154.243 \$
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	114.266 \$	51.864 \$
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	59.605 \$	79.330 \$
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	64.680 €	210.776 €
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	82.974 \$	119.769 \$
L&G Clean Energy UCITS ETF	154.979 \$	65.276 \$
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	244.572 \$	283.250 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF	165.532 £	125.429 £
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	14.073 €	13.008 €
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	16.111 \$	7.189 \$
L&G Digital Payments UCITS ETF	11.223 \$	2.623 \$
L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF <sup>1</sup>	46.909 \$	n. zutr.

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 4. Januar 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 19. Eventualverbindlichkeiten und Verpflichtungen

Zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 gab es keine Eventualverbindlichkeiten oder -verpflichtungen.

#### 20. Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres

##### Brexit und damit verbundene Risiken

Das Vereinigte Königreich (UK) trat am 31. Januar 2020 offiziell aus der Europäischen Union (EU) aus, unterlag aber während eines vereinbarten Übergangszeitraums bis zum 31. Dezember 2020 weiterhin EU-Vorschriften. Obgleich zwischen der EU und dem Vereinigten Königreich im Dezember 2020 ein Freihandelsabkommen abgeschlossen wurde und der Übergangszeitraum am 31. Dezember 2020 endete, waren Finanzdienstleistungen im Wesentlichen nicht Gegenstand dieses Freihandelsabkommens. Am 1. Januar 2021 trat eine Vereinbarung zwischen der britischen Financial Conduct Authority und der Europäischen Wertpapieraufsichtsbehörde (ESMA) (im Namen der Zuständigen Nationalen Behörden der Europäischen Union) in Kraft, die die fortgesetzte Übertragung von Anlageverwaltungsdiensten zwischen der EU und dem Vereinigten Königreich ermöglicht. Für die Gesellschaft ist dies insoweit von Bedeutung, da ein britisches Unternehmen, namentlich Legal & General Investment Management Limited, mit dem Portfoliomanagement beauftragt wurde. Etwaige erforderlichen Änderungen an der Verwaltung und Beaufsichtigung der Gesellschaft und jegliche damit verbundene Übertragung von Zuständigkeiten wurden vor dem 31. Dezember 2020 vorgenommen.

Der Verwaltungsrat überwacht weiterhin alle künftigen Änderungen in den regulatorischen Beziehungen zwischen dem Vereinigten Königreich und der EU und alle potenziellen wirtschaftlichen Auswirkungen auf die Fonds der Gesellschaft auf kontinuierlicher Basis.

##### COVID-19

Seit März 2020 sind die globalen Finanzmärkte von der COVID-19-Pandemie betroffen. Während es in der Weltwirtschaft und den Märkten zu einer starken Verunsicherung kam und Unternehmen sowie das Alltagsleben erheblichen Störungen ausgesetzt waren, hat der Erfolg der Impfprogramme rund um den Globus für eine Stabilisierung der Märkte und eine Rückkehr zu einer gewissen Normalität gesorgt. Angesichts der Lockerung der pandemiebedingten Beschränkungen in den großen Volkswirtschaften gehen wir von einem Anstieg der Infektionsraten und der Möglichkeit aus, dass die Beschränkungen und Volatilität zurückkehren werden. Die Dauer der COVID-19-Pandemie und ihre Auswirkungen lassen sich nicht mit Sicherheit vorhersehen.

Der Verwaltungsrat überwacht weiterhin die künftigen Entwicklungen in der COVID-19-Pandemie sowie alle potenziellen wirtschaftlichen Auswirkungen auf die Fonds der Gesellschaft auf kontinuierlicher Basis.

##### Osteuropa

Am 24. Februar 2022 startete Russlands 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 prozentuale Auswirkung auf das Nettovermögen des Fonds infolge der Anwendung der Richtlinien zur Zeitwertbewertung ist in Anmerkung 12.4 angegeben.

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.

Am 2. Juli 2021 wurde der L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF aufgelegt.

Am 8. Juli 2021 wurde der L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF an der London Stock Exchange („LSE“) gelistet.

Am 12. Juli 2021 wurde der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF aufgelegt.

Am 15. Juli 2021 wurde der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF an der LSE gelistet. Zum selben Termin wurden der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF und der L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF auch an der Borsa Italiana und der Deutschen Börse gelistet.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 20. Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Am 15. Juli 2021 wurden die abgesicherte thesaurierende EUR-Anteilklasse und die abgesicherte thesaurierende CHF-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF zugelassen und zum Vertrieb in Irland, im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, den Niederlanden, Italien, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und Spanien registriert. Die Anteilklassen wurden am 24. August 2021 in der Schweiz registriert und gelistet.

Am 22. Juli 2021 wurde die abgesicherte ausschüttende EUR-Anteilklasse des L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF an der LSE gelistet. Die Anteilklasse ist im Vereinigten Königreich, in Frankreich, Deutschland, den Niederlanden, Italien, Norwegen, Dänemark, Schweden, Finnland, Österreich, Luxemburg und Spanien zum Vertrieb zugelassen.

Am 23. September 2021 wurde der L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF auch an der Deutschen Börse und der Borsa Italiana gelistet.

Am 1. Oktober 2021 wurde die TER für die abgesicherten Anteilklassen des EM Corporate Bond für einen Zeitraum von drei Monaten bis zum 4. Januar 2022 auf 0,19 % gesenkt und danach wieder auf 0,38 % angehoben.

Am 26. Oktober 2021 wurde der L&G India INR Government Bond UCITS ETF aufgelegt.

Der L&G India INR Government Bond UCITS ETF wurde am 28. Oktober 2021 sowohl an der LSE als auch an der Borsa Italiana und an der Deutschen Börse gelistet.

Am 1. November 2021 wurde GO ETF Solutions LLP durch Legal & General Investment Management Limited als Anlageverwalter der Aktien- und synthetischen Fonds der Legal & General UCITS ETF plc ersetzt. Legal & General Investment Management Limited war zuvor nur als Anlageverwalter für die in festverzinslichen Wertpapieren investierten Fonds ernannt worden.

Am 17. November 2021 wurden der L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF, der der L&G Digital Payments UCITS ETF, der L&G India INR Government Bond UCITS ETF und der L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF in der Schweiz registriert und gelistet.

Am 29. November 2021 wurde die abgesicherte ausschüttende GBP-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF zugelassen und an der LSE gelistet.

Am 3. Dezember 2021 erfolgte an den eingetragenen Anteilhaber des L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF, The Bank of New York (Depository) Nominees Limited, eine Mitteilung, um ihn über die Schließung des Fonds zu unterrichten. Die Anleger in dem Fonds waren am 14. Januar 2022 Gegenstand einer Zwangsrücknahme.

Die Fonds haben keine „Vorzugsnotierung“ und haben stattdessen am 4. Januar 2022 auf eine „Standardnotierung“ gewechselt.

Am 18. Februar 2022 wurde die abgesicherte ausschüttende CHF-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF zugelassen, in der Schweiz registriert sowie am 24. März 2022 an der Swiss SIX Exchange gelistet.

Am 23. Februar 2022 wurde der Hauptverkaufsprospekt der Gesellschaft aktualisiert, um die Ernennung der Legal & General Investment Management Limited zum Anlageverwalter für alle Teilfonds der Gesellschaft sowie die Nachhaltigkeitspolitik zu berücksichtigen, um klarzustellen, dass Prozesskosten von der Gesellschaft aus dem Vermögen der einzelnen Fonds gezahlt werden, und um die Abschnitte „Nachhaltigkeitsrisiken“ und „Risiko der Anlage in Chinas Interbank Bond Market über Bond Connect“ im Risikoabschnitt aufzunehmen. Anderen Absätzen mit zeitlichen Aktualisierungen wurde ebenfalls Rechnung getragen.

Am 6. April 2022 wurde die abgesicherte thesaurierende EUR-Anteilklasse des L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF zugelassen, in Deutschland, Italien, Österreich und der Schweiz registriert sowie am 11. Mai 2022 an der Borsa Italiana und der Deutschen Börse gelistet.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse im Geschäftsjahr, die eine Auswirkung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 haben.

## Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

#### 21. Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres

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

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

Am 7. September 2022 wurden die folgenden Fonds aufgelegt und 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 29. September 2022 genehmigte der Verwaltungsrat auf seiner Sitzung die Nicht-Anwendung des UK Code. Die Einhaltung des britischen Code ist nach dem am 4. Januar 2022 erfolgten Wechsel der Gesellschaft in das Standardsegment am Hauptmarkt der LSE keine regulatorische Anforderung mehr.

#### Finanzmärkte im Vereinigten Königreich

Angesichts der jüngsten Ereignisse an den Finanzmärkten im Vereinigten Königreich beobachtet der Verwaltungsrat Entwicklungen und alle potenziellen Liquiditäts- und Volatilitätsrisiken, die sich auf die Fonds der Gesellschaft auswirken könnten, genau. Der Verwaltungsrat hält es für unwahrscheinlich, dass diese Entwicklungen wesentliche direkte Auswirkungen auf die Fonds der Gesellschaft haben werden.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres, die eine Auswirkung auf den Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 haben.

#### 22. Genehmigung des Halbjahresabschlusses

Der Verwaltungsrat hat den geprüften Abschluss am 26. Oktober 2022 genehmigt.

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %)</b>			
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,16 %)</b>			
1.100	BeiGene Ltd	16.322	0,05
3.200	China Resources Microelectronics Ltd	28.236	0,09
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>44.558</b>	<b>0,14</b>
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %)</b>			
23.900	360 Security Technology Inc 'A'	30.418	0,10
20.800	37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	65.964	0,21
300	3peak Inc 'A'	25.167	0,08
9.800	Addsino Co Ltd	17.479	0,05
13.400	AECC Aero-Engine Control Co Ltd	56.248	0,18
21.900	AECC Aviation Power Co Ltd 'A'	148.883	0,47
227.515	Agricultural Bank of China Ltd 'A'	102.639	0,32
19.474	Aier Eye Hospital Group Co Ltd	130.238	0,41
8.800	Air China Ltd 'A'	15.262	0,05
7.100	Aisino Corp 'A'	11.603	0,04
51.100	Aluminum Corp of China Ltd 'A'	36.258	0,11
1.700	Amlogic Shanghai Co Ltd 'A'	25.649	0,08
3.300	Andon Health Co Ltd	29.607	0,09
4.600	Angel Yeast Co Ltd 'A'	33.499	0,10
4.240	Anhui Anke Biotechnology Group Co Ltd	6.403	0,02
17.163	Anhui Conch Cement Co Ltd 'A'	90.452	0,28
800	Anhui Gujing Distillery Co Ltd	29.835	0,09
3.640	Anhui Honglu Steel Construction Group Co Ltd	18.161	0,06
14.548	Anhui Jianghuai Automobile Group Corp Ltd 'A'	37.292	0,12
2.700	Anhui Kouzi Distillery Co Ltd 'A'	23.639	0,07
4.100	Anhui Yingjia Distillery Co Ltd 'A'	39.896	0,12
7.612	Anhui Zhongding Sealing Parts Co Ltd	20.740	0,06
800	Anjoy Foods Group Co Ltd 'A'	20.061	0,06
5.500	Apeloa Pharmaceutical Co Ltd	16.958	0,05

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
1.300	Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd	56.122	0,18
1.600	Autel Intelligent Technology Corp Ltd 'A'	7.868	0,02
3.200	Autobio Diagnostics Co Ltd 'A'	23.370	0,07
4.900	Avary Holding Shenzhen Co Ltd	22.113	0,07
24.575	AVIC Electromechanical Systems Co Ltd	45.337	0,14
44.400	AVIC Industry-Finance Holdings Co Ltd 'A'	22.948	0,07
6.397	AVICOPTER Plc 'A'	43.193	0,14
10.000	BAIC BluePark New Energy Technology Co Ltd 'A'	13.848	0,04
110.544	Bank of Beijing Co Ltd 'A'	74.970	0,23
17.600	Bank of Changsha Co Ltd 'A'	20.849	0,07
9.100	Bank of Chengdu Co Ltd 'A'	22.538	0,07
83.700	Bank of China Ltd 'A'	40.760	0,13
164.960	Bank of Communications Co Ltd 'A'	122.716	0,38
9.420	Bank of Guiyang Co Ltd 'A'	8.176	0,03
19.200	Bank of Hangzhou Co Ltd 'A'	42.964	0,13
109.500	Bank of Jiangsu Co Ltd 'A'	116.463	0,36
42.823	Bank of Nanjing Co Ltd 'A'	66.656	0,21
29.140	Bank of Ningbo Co Ltd	155.879	0,49
71.660	Bank of Shanghai Co Ltd 'A'	70.115	0,22
7.700	Bank of Suzhou Co Ltd	7.016	0,02
39.380	Bank of Zhengzhou Co Ltd	15.824	0,05
3.700	Baoji Titanium Industry Co Ltd 'A'	32.831	0,10
65.029	Baoshan Iron & Steel Co Ltd 'A'	58.479	0,18
29.300	BBMG Corp 'A'	12.124	0,04
2.000	Beijing BDStar Navigation Co Ltd	9.429	0,03
2.860	Beijing Bei Mo Gao Ke Friction Material Co Ltd	25.027	0,08
4.893	Beijing Capital Development Co Ltd 'A'	3.589	0,01
14.190	Beijing Capital Eco-Environment Protection Group Co Ltd 'A'	6.147	0,02
22.446	Beijing Dabeinong Technology Group Co Ltd	26.187	0,08
2.000	Beijing Easpring Material Technology Co Ltd	26.990	0,08

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
4.752	Beijing E-Hualu Information Technology Co Ltd	12.352	0,04
8.300	Beijing Enlight Media Co Ltd	11.741	0,04
12.000	Beijing Haixin Energy Technology Co Ltd	9.070	0,03
300	Beijing Huafeng Test & Control Technology Co Ltd 'A'	15.972	0,05
10.500	Beijing Jingyuntong Technology Co Ltd 'A'	12.579	0,04
1.300	Beijing Kingsoft Office Software Inc 'A'	38.280	0,12
7.000	Beijing New Building Materials Plc	36.201	0,11
16.280	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd	125.171	0,39
12.300	Beijing Originwater Technology Co Ltd	9.573	0,03
200	Beijing Roborock Technology Co Ltd 'A'	18.425	0,06
4.900	Beijing Shiji Information Technology Co Ltd	11.616	0,04
6.010	Beijing Shunxin Agriculture Co Ltd	24.078	0,08
12.800	Beijing Sinnet Technology Co Ltd	19.924	0,06
4.780	Beijing Tiantan Biological Products Corp Ltd 'A'	17.337	0,05
4.900	Beijing Tongrentang Co Ltd 'A'	38.706	0,12
2.393	Beijing United Information Technology Co Ltd 'A'	31.672	0,10
1.305	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd 'A'	30.274	0,09
5.910	Beijing Yanjing Brewery Co Ltd	8.528	0,03
1.300	Beijing Yuanliu Hongyuan Electronic Technology Co Ltd 'A'	26.086	0,08
111.100	Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd 'A'	83.313	0,26
46.500	Beiqi Foton Motor Co Ltd 'A'	19.658	0,06
1.400	Bethel Automotive Safety Systems Co Ltd 'A'	16.768	0,05
2.800	Betta Pharmaceuticals Co Ltd	25.431	0,08
1.600	BGI Genomics Co Ltd	17.137	0,05
800	Bloomage Biotechnology Corp Ltd 'A'	16.991	0,05
2.800	Blue Sail Medical Co Ltd	3.994	0,01
10.000	BOC International China Co Ltd 'A'	19.868	0,06
266.256	BOE Technology Group Co Ltd	156.708	0,49
7.600	Bright Dairy & Food Co Ltd 'A'	14.339	0,04

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
5.600	BTG Hotels Group Co Ltd 'A'	20.746	0,07
7.307	BYD Co Ltd	364.013	1,14
3.600	By-health Co Ltd	11.643	0,04
4.500	C&S Paper Co Ltd	8.416	0,03
26.780	Caitong Securities Co Ltd 'A'	31.473	0,10
1.200	Cambricon Technologies Corp Ltd 'A'	11.598	0,04
300	CanSino Biologics Inc 'A'	8.922	0,03
13.700	CECEP Solar Energy Co Ltd	17.088	0,05
19.000	CECEP Wind-Power Corp 'A'	13.624	0,04
6.800	Central China Securities Co Ltd 'A'	4.236	0,01
13.200	Centre Testing International Group Co Ltd	45.766	0,14
2.900	Chacha Food Co Ltd	24.662	0,08
1.750	Changchun High & New Technology Industry Group Inc	61.020	0,19
29.200	Changjiang Securities Co Ltd	25.866	0,08
1.100	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd 'A'	28.099	0,09
9.500	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	42.715	0,13
12.636	Chengdu Xingrong Environment Co Ltd	9.646	0,03
16.100	Chengtun Mining Group Co Ltd 'A'	18.663	0,06
4.700	Chengxin Lithium Group Co Ltd	42.378	0,13
11.600	Chifeng Jilong Gold Mining Co Ltd 'A'	27.638	0,09
17.128	China Baoan Group Co Ltd	34.515	0,11
59.160	China Construction Bank Corp 'A'	53.554	0,17
18.300	China CSSC Holdings Ltd 'A'	51.885	0,16
33.128	China Eastern Airlines Corp Ltd 'A'	27.168	0,09
165.687	China Energy Engineering Corp Ltd 'A'	58.659	0,18
151.900	China Everbright Bank Co Ltd 'A'	68.300	0,21
6.300	China Film Co Ltd 'A'	10.823	0,03
44.000	China First Heavy Industries 'A'	20.178	0,06
4.596	China Fortune Land Development Co Ltd 'A'	2.197	0,01

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
16.100	China Galaxy Securities Co Ltd 'A'	23.257	0,07
22.300	China Grand Automotive Services Group Co Ltd 'A'	8.694	0,03
7.000	China Great Wall Securities Co Ltd	10.624	0,03
14.849	China Greatwall Technology Group Co Ltd	24.000	0,08
27.700	China Hainan Rubber Industry Group Co Ltd 'A'	19.779	0,06
4.500	China International Capital Corp Ltd 'A'	29.907	0,09
11.165	China International Marine Containers Group Co Ltd	23.100	0,07
23.221	China Jushi Co Ltd 'A'	60.391	0,19
6.306	China Life Insurance Co Ltd 'A'	29.277	0,09
6.580	China Meheco Co Ltd 'A'	14.567	0,05
109.827	China Merchants Bank Co Ltd 'A'	692.335	2,17
7.711	China Merchants Energy Shipping Co Ltd 'A'	6.635	0,02
21.743	China Merchants Securities Co Ltd 'A'	46.803	0,15
20.112	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	40.348	0,13
5.900	China Minmetals Rare Earth Co Ltd	27.542	0,09
183.346	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A'	101.885	0,32
2.024	China National Medicines Corp Ltd 'A'	8.097	0,03
3.380	China National Software & Service Co Ltd 'A'	20.494	0,06
18.202	China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd 'A'	95.601	0,30
23.865	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'A'	83.884	0,26
97.809	China Petroleum & Chemical Corp 'A'	59.612	0,19
77.000	China Railway Group Ltd 'A'	70.624	0,22
16.000	China Railway Hi-tech Industry Co Ltd 'A'	19.240	0,06
320.100	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'A'	216.610	0,68
2.500	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd	16.805	0,05
17.614	China Shenhua Energy Co Ltd 'A'	87.619	0,27
31.197	China Southern Airlines Co Ltd 'A'	34.066	0,11
168.200	China State Construction Engineering Corp Ltd 'A'	133.669	0,42
80.800	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd 'A'	75.920	0,24

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
8.058	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd 'A'	280.380	0,88
4.500	China TransInfo Technology Co Ltd	7.475	0,02
52.161	China Vanke Co Ltd	159.733	0,50
2.624	China Wafer Level CSP Co Ltd 'A'	11.128	0,03
19.200	China XD Electric Co Ltd 'A'	13.423	0,04
70.584	China Yangtze Power Co Ltd 'A'	243.775	0,76
3.100	China Zhenhua Group Science & Technology Co Ltd	62.965	0,20
50.700	China Zheshang Bank Co Ltd 'A'	25.144	0,08
1.600	Chongqing Brewery Co Ltd 'A'	35.039	0,11
38.602	Chongqing Changan Automobile Co Ltd	99.874	0,31
3.300	Chongqing Fuling Zhacai Group Co Ltd	17.017	0,05
49.600	Chongqing Iron & Steel Co Ltd 'A'	14.152	0,04
43.700	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'A'	24.153	0,08
3.600	Chongqing Sokon Industry Group Co Ltd 'A'	43.608	0,14
5.500	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	91.205	0,29
28.000	CITIC Heavy Industries Co Ltd 'A'	15.852	0,05
74.182	CITIC Securities Co Ltd 'A'	240.022	0,75
47.500	CMOC Group Ltd 'A'	40.658	0,13
1.600	CNGR Advanced Material Co Ltd	29.613	0,09
7.700	CNHTC Jinan Truck Co Ltd	14.941	0,05
12.400	CNNC Hua Yuan Titanium Dioxide Co Ltd	13.207	0,04
12.400	CNOOC Energy Technology & Services Ltd 'A'	4.779	0,02
6.200	COFCO Biotechnology Co Ltd	8.372	0,03
12.400	COFCO Sugar Holding Co Ltd 'A'	13.929	0,04
9.700	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	773.762	2,42
27.880	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'A'	12.494	0,04
18.700	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'A'	28.856	0,09
40.043	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'A'	83.145	0,26

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
11.900	CSC Financial Co Ltd 'A'	51.391	0,16
9.000	CSG Holding Co Ltd	9.976	0,03
10.112	Daan Gene Co Ltd	25.966	0,08
48.834	Daqin Railway Co Ltd 'A'	48.073	0,15
1.296	DaShenLin Pharmaceutical Group Co Ltd 'A'	6.060	0,02
17.868	DHC Software Co Ltd	16.869	0,05
3.900	Dian Diagnostics Group Co Ltd	18.118	0,06
5.000	Do-Fluoride New Materials Co Ltd	36.531	0,11
3.227	Dong-E-E-Jiao Co Ltd	17.812	0,06
5.800	Dongfang Electric Corp Ltd 'A'	14.252	0,04
14.800	Dongxing Securities Co Ltd 'A'	19.647	0,06
10.800	East Group Co Ltd	13.100	0,04
85.176	East Money Information Co Ltd	323.181	1,01
1.000	Ecovacs Robotics Co Ltd 'A'	18.208	0,06
6.800	ENN Natural Gas Co Ltd 'A'	18.884	0,06
4.621	Eoptolink Technology Inc Ltd	18.086	0,06
7.500	Estun Automation Co Ltd	27.449	0,09
11.424	Eve Energy Co Ltd	166.386	0,52
15.300	Everbright Securities Co Ltd 'A'	36.020	0,11
500	Eyebright Medical Technology Beijing Co Ltd 'A'	16.746	0,05
24.050	Fangda Carbon New Material Co Ltd 'A'	27.304	0,09
15.198	Fangda Special Steel Technology Co Ltd 'A'	15.869	0,05
3.200	Farasis Energy Gan Zhou Co Ltd 'A'	13.580	0,04
5.901	FAW Jiefang Group Co Ltd	8.233	0,03
9.529	Fiberhome Telecommunication Technologies Co Ltd 'A'	20.612	0,06
7.900	Financial Street Holdings Co Ltd	7.022	0,02
20.000	First Capital Securities Co Ltd	19.151	0,06
6.100	Flat Glass Group Co Ltd 'A'	34.718	0,11
132.580	Focus Media Information Technology Co Ltd	133.287	0,42

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
10.226	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	138.031	0,43
41.665	Founder Securities Co Ltd 'A'	41.763	0,13
27.500	Foxconn Industrial Internet Co Ltd 'A'	40.422	0,13
7.000	Fujian Sunner Development Co Ltd	20.056	0,06
11.200	Fushun Special Steel Co Ltd 'A'	29.948	0,09
14.017	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'A'	87.545	0,27
6.850	Ganfeng Lithium Co Ltd	152.158	0,48
200	G-bits Network Technology Xiamen Co Ltd 'A'	11.592	0,04
25.300	GCL System Integration Technology Co Ltd	14.059	0,04
98.863	GD Power Development Co Ltd 'A'	57.744	0,18
37.220	GEM Co Ltd	50.596	0,16
21.338	Gemdale Corp 'A'	42.840	0,13
22.700	GF Securities Co Ltd	63.411	0,20
8.000	Giant Network Group Co Ltd	10.935	0,03
4.556	Gigadevice Semiconductor Beijing Inc 'A'	96.785	0,30
750	Ginlong Technologies Co Ltd	23.864	0,07
7.208	Glodon Co Ltd	58.618	0,18
19.570	GoerTek Inc	98.226	0,31
7.500	Gotion High-tech Co Ltd	51.088	0,16
7.100	Grandblue Environment Co Ltd 'A'	21.742	0,07
7.500	Great Wall Motor Co Ltd 'A'	41.498	0,13
40.472	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	203.862	0,64
15.750	Greenland Holdings Corp Ltd 'A'	9.317	0,03
10.900	GRG Banking Equipment Co Ltd	15.094	0,05
8.900	Guangdong Fenghua Advanced Technology Holding Co Ltd	24.981	0,08
6.900	Guangdong Haid Group Co Ltd	61.854	0,19
12.700	Guangdong HEC Technology Holding Co Ltd 'A'	17.055	0,05
4.100	Guangdong Hongda Holdings Group Co Ltd	17.045	0,05
1.500	Guangdong Jia Yuan Technology Shares Co Ltd 'A'	19.017	0,06

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
700	Guangdong Kinlong Hardware Products Co Ltd	13.564	0,04
32.480	Guanghui Energy Co Ltd 'A'	51.139	0,16
42.434	Guangshen Railway Co Ltd 'A'	13.819	0,04
8.100	Guangzhou Baiyun International Airport Co Ltd 'A'	18.041	0,06
4.039	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'A'	19.060	0,06
12.400	Guangzhou Haige Communications Group Inc Co	16.838	0,05
2.200	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd 'A'	27.129	0,08
3.100	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	34.879	0,11
10.260	Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd	95.116	0,30
840	Guangzhou Wondfo Biotech Co Ltd	5.108	0,02
20.041	Guangzhou Yuexiu Financial Holdings Group Co Ltd	21.046	0,07
1.700	Guolian Securities Co Ltd 'A'	3.116	0,01
15.400	Guosen Securities Co Ltd	22.015	0,07
33.400	Guotai Junan Securities Co Ltd 'A'	75.838	0,24
22.777	Guoyuan Securities Co Ltd	21.163	0,07
32.200	Haier Smart Home Co Ltd 'A'	132.084	0,41
3.218	Hainan Poly Pharm Co Ltd	16.897	0,05
54.485	Haitong Securities Co Ltd 'A'	79.844	0,25
6.200	Hang Zhou Great Star Industrial Co Ltd	17.449	0,05
2.100	Hangzhou Chang Chuan Technology Co Ltd	14.164	0,04
4.788	Hangzhou First Applied Material Co Ltd 'A'	46.862	0,15
2.516	Hangzhou Lion Electronics Co Ltd 'A'	25.324	0,08
4.300	Hangzhou Oxygen Plant Group Co Ltd	20.079	0,06
3.400	Hangzhou Robam Appliances Co Ltd	18.299	0,06
8.700	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd 'A'	67.580	0,21
4.250	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	72.661	0,23
6.805	Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd	33.678	0,11
2.200	Hebei Hengshui Laobaigan Liquor Co Ltd 'A'	9.429	0,03
3.280	Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co Ltd 'A'	11.132	0,03
7.000	Heilongjiang Agriculture Co Ltd 'A'	15.434	0,05

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
8.200	Henan Mingtai AI Industrial Co Ltd 'A'	29.153	0,09
15.400	Henan Shenhua Coal & Power Co Ltd	30.090	0,09
6.717	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	29.399	0,09
6.700	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd	26.643	0,08
17.440	Hengli Petrochemical Co Ltd 'A'	57.940	0,18
15.980	Hengtong Optic-electric Co Ltd 'A'	34.708	0,11
17.260	Hengyi Petrochemical Co Ltd	27.098	0,08
35.172	Hesteel Co Ltd	11.874	0,04
6.100	Hisense Visual Technology Co Ltd 'A'	11.390	0,04
1.900	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	27.290	0,09
5.320	Hongfa Technology Co Ltd 'A'	33.258	0,10
800	Hoshine Silicon Industry Co Ltd 'A'	14.097	0,04
13.200	Huaan Securities Co Ltd 'A'	8.972	0,03
39.200	Huadian Power International Corp Ltd 'A'	23.013	0,07
6.858	Huadong Medicine Co Ltd	46.264	0,14
12.700	Huafon Chemical Co Ltd	16.012	0,05
5.856	Huagong Tech Co Ltd	20.269	0,06
6.300	Huaibei Mining Holdings Co Ltd 'A'	13.702	0,04
8.465	Hualan Biological Engineering Inc	28.831	0,09
25.200	Huaneng Power International Inc 'A'	26.501	0,08
33.167	Huatai Securities Co Ltd 'A'	70.354	0,22
15.300	Huaxi Securities Co Ltd	17.919	0,06
34.392	Huaxia Bank Co Ltd 'A'	26.766	0,08
4.900	Huaxin Cement Co Ltd 'A'	14.281	0,04
12.281	Huayu Automotive Systems Co Ltd 'A'	42.195	0,13
32.600	Hubei Biocause Pharmaceutical Co Ltd	16.606	0,05
26.400	Hubei Energy Group Co Ltd	20.152	0,06
6.100	Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd 'A'	40.085	0,13
5.100	Hubei Yihua Chemical Industry Co Ltd	15.473	0,05

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
700	Huizhou Desay Sv Automotive Co Ltd	15.476	0,05
4.770	Humanwell Healthcare Group Co Ltd 'A'	11.401	0,04
4.600	Hunan Changyuan Lico Co Ltd 'A'	13.743	0,04
24.620	Hunan Valin Steel Co Ltd	18.720	0,06
9.682	Hundsun Technologies Inc 'A'	62.972	0,20
14.511	Iflytek Co Ltd	89.351	0,28
540	Imeik Technology Development Co Ltd	48.400	0,15
172.168	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A'	122.678	0,38
125.735	Industrial Bank Co Ltd 'A'	373.769	1,17
36.764	Industrial Securities Co Ltd 'A'	38.717	0,12
1.700	Ingenic Semiconductor Co Ltd	26.982	0,08
193.333	Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd 'A'	67.869	0,21
6.900	Inner Mongolia Dian Tou Energy Corp Ltd	14.760	0,05
18.600	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd 'A'	13.559	0,04
30.300	Inner Mongolia MengDian HuaNeng Thermal Power Corp Ltd 'A'	16.521	0,05
46.606	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A'	271.171	0,85
11.800	Inner Mongolia Yuan Xing Energy Co Ltd	18.526	0,06
13.800	Inspur Electronic Information Industry Co Ltd	54.587	0,17
3.240	Intco Medical Technology Co Ltd	12.274	0,04
16.200	IRICO Display Devices Co Ltd 'A'	11.325	0,04
7.560	JA Solar Technology Co Ltd	89.103	0,28
3.220	Jafron Biomedical Co Ltd	24.478	0,08
2.600	Jason Furniture Hangzhou Co Ltd 'A'	21.995	0,07
12.300	JCET Group Co Ltd 'A'	49.609	0,16
20.100	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd 'A'	22.939	0,07
1.500	Jiangsu Cnano Technology Co Ltd 'A'	37.976	0,12
7.900	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd	19.956	0,06
420	Jiangsu GoodWe Power Supply Technology Co Ltd 'A'	19.638	0,06
2.740	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd 'A'	25.262	0,08
31.639	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd 'A'	175.297	0,55

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
4.300	Jiangsu Hoperun Software Co Ltd	11.530	0,04
3.800	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd 'A'	28.950	0,09
8.600	Jiangsu Nhwa Pharmaceutical Co Ltd	17.472	0,05
4.500	Jiangsu Shuangxing Color Plastic New Materials Co Ltd	12.160	0,04
4.900	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	134.059	0,42
1.800	Jiangsu Yangnong Chemical Co Ltd 'A'	35.837	0,11
2.500	Jiangsu Yoke Technology Co Ltd	20.730	0,06
5.200	Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd	19.932	0,06
23.600	Jiangsu Zhongnan Construction Group Co Ltd	10.752	0,03
20.750	Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd 'A'	71.602	0,22
9.400	Jiangxi Copper Co Ltd 'A'	25.036	0,08
16.400	Jiangxi Special Electric Motor Co Ltd	61.344	0,19
9.700	Jiangxi Zhengbang Technology Co Ltd	8.781	0,03
7.157	Jilin Aodong Pharmaceutical Group Co Ltd	15.780	0,05
16.300	Jinke Properties Group Co Ltd	6.964	0,02
6.500	Jinneng Holding Shanxi Coal Industry Co Ltd 'A'	17.235	0,05
7.129	Jinyu Bio-Technology Co Ltd 'A'	9.755	0,03
2.100	JiuGui Liquor Co Ltd	58.288	0,18
2.400	JL Mag Rare-Earth Co Ltd	13.193	0,04
5.100	Joincare Pharmaceutical Group Industry Co Ltd 'A'	9.409	0,03
1.380	Joinn Laboratories China Co Ltd 'A'	23.459	0,07
7.100	Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd 'A'	12.632	0,04
5.100	Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding Co Ltd 'A'	26.367	0,08
3.000	Juwei Food Co Ltd 'A'	25.912	0,08
9.200	Juneyao Airlines Co Ltd 'A'	24.724	0,08
700	KBC Corp Ltd 'A'	30.816	0,10
11.100	Keda Industrial Group Co Ltd 'A'	34.224	0,11
18.000	Kingfa Sci & Tech Co Ltd 'A'	25.598	0,08
10.800	Kuang-Chi Technologies Co Ltd	27.862	0,09

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
5.500	Kunlun Tech Co Ltd	13.145	0,04
4.487	Kweichow Moutai Co Ltd 'A'	1.370.704	4,29
1.600	Lakala Payment Co Ltd	4.556	0,01
2.210	Laobaixing Pharmacy Chain JSC 'A'	11.185	0,04
10.900	LB Group Co Ltd	32.646	0,10
22.400	Lens Technology Co Ltd	37.042	0,12
67.789	Leo Group Co Ltd	19.645	0,06
13.800	Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd	38.281	0,12
13.600	Leyard Optoelectronic Co Ltd	14.831	0,05
4.900	Lianhe Chemical Technology Co Ltd	11.982	0,04
12.153	Liaoning Cheng Da Co Ltd 'A'	26.469	0,08
23.400	Liaoning Port Co Ltd 'A'	5.942	0,02
25.500	Lingyi iTech Guangdong Co	19.122	0,06
2.070	Livzon Pharmaceutical Group Inc	11.197	0,04
50.212	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	499.772	1,56
1.870	Luoyang Xinqianglian Slewing Bearing Co Ltd	24.870	0,08
14.000	Luxi Chemical Group Co Ltd	36.159	0,11
38.163	Luxshare Precision Industry Co Ltd	192.631	0,60
6.200	Luzhou Laojiao Co Ltd	228.336	0,71
7.100	Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'A'	4.020	0,01
1.300	Maccura Biotechnology Co Ltd	3.979	0,01
8.200	Mango Excellent Media Co Ltd	40.863	0,13
2.515	Maxscend Microelectronics Co Ltd	50.718	0,16
16.872	Meihua Holdings Group Co Ltd 'A'	28.430	0,09
22.060	Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd	18.355	0,06
82.100	Metallurgical Corp of China Ltd 'A'	42.925	0,13
4.950	Mianyang Fulin Precision Co Ltd	16.268	0,05
980	Micro-Tech Nanjing Co Ltd 'A'	12.765	0,04
40.142	Midea Group Co Ltd	362.125	1,13

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
10.700	Ming Yang Smart Energy Group Ltd 'A'	54.025	0,17
20.500	Minmetals Capital Co Ltd 'A'	14.975	0,05
4.200	MLS Co Ltd	6.130	0,02
5.000	Montage Technology Co Ltd 'A'	45.247	0,14
20.366	Muyuan Foods Co Ltd	168.147	0,53
12.200	NanJi E-Commerce Co Ltd	9.732	0,03
1.200	Nanjing Hanrui Cobalt Co Ltd	10.383	0,03
35.900	Nanjing Iron & Steel Co Ltd 'A'	16.893	0,05
4.225	Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co Ltd 'A'	17.798	0,06
18.700	Nanjing Securities Co Ltd 'A'	23.297	0,07
24.463	NARI Technology Co Ltd 'A'	98.666	0,31
9.000	National Silicon Industry Group Co Ltd 'A'	30.895	0,10
2.400	NAURA Technology Group Co Ltd	99.351	0,31
16.225	NavInfo Co Ltd	36.525	0,11
6.977	New China Life Insurance Co Ltd 'A'	33.549	0,11
12.600	New Hope Liuhe Co Ltd	28.798	0,09
4.000	Newland Digital Technology Co Ltd	7.893	0,02
4.100	Ninestar Corp	31.003	0,10
1.460	Ningbo Deye Technology Co Ltd 'A'	61.043	0,19
8.640	Ningbo Joyson Electronic Corp 'A'	20.276	0,06
3.300	Ningbo Orient Wires & Cables Co Ltd 'A'	37.760	0,12
2.400	Ningbo Ronbay New Energy Technology Co Ltd 'A'	46.406	0,15
10.680	Ningbo Shanshan Co Ltd 'A'	47.415	0,15
4.300	Ningbo Tuopu Group Co Ltd 'A'	43.955	0,14
17.100	Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd 'A'	37.422	0,12
8.000	North China Pharmaceutical Co Ltd 'A'	8.031	0,03
5.582	Northeast Securities Co Ltd	5.829	0,02
11.000	Nuode Investment Co Ltd 'A'	19.094	0,06
20.491	Offshore Oil Engineering Co Ltd 'A'	12.703	0,04

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
19.916	OFILM Group Co Ltd	19.963	0,06
1.580	Oppein Home Group Inc 'A'	35.564	0,11
41.216	Orient Securities Co Ltd/China 'A'	62.841	0,20
15.400	Oriental Energy Co Ltd	21.417	0,07
11.393	Oriental Pearl Group Co Ltd 'A'	12.169	0,04
3.000	Ovctek China Inc	25.629	0,08
54.537	Pacific Securities Co Ltd/The/China 'A'	24.359	0,08
900	Pacific Shuanglin Bio-pharmacy Co Ltd	2.952	0,01
72.600	Pang Da Automobile Trade Co Ltd 'A'	15.075	0,05
41.000	Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co Ltd	23.274	0,07
26.600	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'A'	20.106	0,06
11.400	Perfect World Co Ltd/China	24.471	0,08
68.383	PetroChina Co Ltd 'A'	54.140	0,17
900	PharmaBlock Sciences Nanjing Inc	13.308	0,04
3.600	Pharmaron Beijing Co Ltd	51.207	0,16
55.200	Ping An Bank Co Ltd	123.522	0,39
77.198	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	538.424	1,68
10.800	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co Ltd 'A'	21.925	0,07
12.300	Polaris Bay Group Co Ltd 'A'	15.581	0,05
55.459	Poly Developments and Holdings Group Co Ltd 'A'	144.647	0,45
3.100	Porton Pharma Solutions Ltd	36.116	0,11
79.300	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'A'	63.849	0,20
64.384	Power Construction Corp of China Ltd 'A'	75.691	0,24
980	Proya Cosmetics Co Ltd 'A'	24.181	0,08
2.100	Qi An Xin Technology Group Inc 'A'	17.504	0,05
5.184	Qianhe Condiment and Food Co Ltd 'A'	13.397	0,04
35.100	Qingdao Rural Commercial Bank Corp	17.408	0,05
5.800	Qingdao TGOOD Electric Co Ltd	14.998	0,05
910	Quectel Wireless Solutions Co Ltd 'A'	18.169	0,06
2.600	Raytron Technology Co Ltd 'A'	15.427	0,05

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
21.700	RiseSun Real Estate Development Co Ltd	9.822	0,03
3.500	Riyue Heavy Industry Co Ltd 'A'	13.280	0,04
28.500	Rongsheng Petrochemical Co Ltd	65.521	0,21
21.147	SAIC Motor Corp Ltd 'A'	56.261	0,18
17.900	Sailun Group Co Ltd 'A'	30.135	0,09
21.381	Sanan Optoelectronics Co Ltd 'A'	78.506	0,25
1.600	Sangfor Technologies Inc	24.804	0,08
6.150	Sansteel Minguang Co Ltd Fujian	5.595	0,02
57.682	Sany Heavy Industry Co Ltd 'A'	164.232	0,51
10.102	Satellite Chemical Co Ltd	39.009	0,12
24.636	SDIC Capital Co Ltd 'A'	23.406	0,07
20.847	SDIC Power Holdings Co Ltd 'A'	32.698	0,10
39.950	Sealand Securities Co Ltd	21.663	0,07
4.900	Seazen Holdings Co Ltd 'A'	18.614	0,06
14.000	SF Holding Co Ltd	116.717	0,37
2.400	SG Micro Corp	65.257	0,20
27.200	Shaanxi Coal Industry Co Ltd 'A'	86.058	0,27
9.595	Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co Ltd 'A'	22.159	0,07
6.600	Shandong Buchang Pharmaceuticals Co Ltd 'A'	19.432	0,06
15.700	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd	13.227	0,04
12.354	Shandong Gold Mining Co Ltd 'A'	34.252	0,11
6.800	Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co Ltd	22.693	0,07
11.436	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd 'A'	49.883	0,16
65.600	Shandong Iron and Steel Co Ltd 'A'	17.051	0,05
3.900	Shandong Linglong Tyre Co Ltd 'A'	14.780	0,05
57.788	Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd 'A'	31.854	0,10
4.000	Shandong Pharmaceutical Glass Co Ltd 'A'	16.701	0,05
1.200	Shandong Shida Shenghua Chemical Group Co Ltd 'A'	26.055	0,08
7.500	Shandong Sinocera Functional Material Co Ltd	40.243	0,13
12.200	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd	22.434	0,07

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
5.200	Shanghai Aiko Solar Energy Co Ltd 'A'	25.649	0,08
9.129	Shanghai Bailian Group Co Ltd 'A'	18.014	0,06
3.332	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co Ltd	14.952	0,05
3.170	Shanghai Baosight Software Co Ltd 'A'	25.855	0,08
800	Shanghai Chinafortune Co Ltd 'A'	1.735	0,01
44.474	Shanghai Construction Group Co Ltd 'A'	20.130	0,06
16.200	Shanghai Electric Group Co Ltd 'A'	9.946	0,03
9.900	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'A'	65.203	0,20
140	Shanghai Friendess Electronic Technology Corp Ltd 'A'	4.602	0,01
7.278	Shanghai International Airport Co Ltd 'A'	61.644	0,19
28.884	Shanghai International Port Group Co Ltd 'A'	25.155	0,08
3.584	Shanghai Jahwa United Co Ltd 'A'	22.888	0,07
3.000	Shanghai Jinjiang International Hotels Co Ltd 'A'	28.188	0,09
2.300	Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'A'	25.885	0,08
8.520	Shanghai Lingang Holdings Corp Ltd 'A'	17.258	0,05
2.503	Shanghai M&G Stationery Inc 'A'	20.968	0,07
700	Shanghai Medicilon Inc 'A'	35.512	0,11
2.000	Shanghai Milkground Food Tech Co Ltd 'A'	13.982	0,04
9.230	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'A'	24.928	0,08
131.433	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd 'A'	157.265	0,49
4.840	Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd 'A'	61.021	0,19
23.200	Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd	20.551	0,06
26.080	Shanghai Tunnel Engineering Co Ltd 'A'	23.843	0,07
2.600	Shanghai Wanye Enterprises Co Ltd 'A'	7.574	0,02
6.900	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd 'A'	9.730	0,03
9.500	Shanghai Zhangjiang High-Tech Park Development Co Ltd 'A'	17.668	0,06
8.711	Shanghai Zhenhua Heavy Industries Co Ltd 'A'	4.372	0,01
12.200	Shanxi Coal International Energy Group Co Ltd 'A'	35.465	0,11
15.671	Shanxi Coking Coal Energy Group Co Ltd	31.345	0,10
8.600	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd 'A'	18.782	0,06

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
20.300	Shanxi Meijin Energy Co Ltd	36.996	0,12
8.900	Shanxi Securities Co Ltd	7.631	0,02
9.800	Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd	7.978	0,03
3.500	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd 'A'	169.816	0,53
34.600	Shanying International Holding Co Ltd 'A'	14.317	0,04
2.100	Shede Spirits Co Ltd 'A'	63.992	0,20
6.200	Shenergy Co Ltd 'A'	5.261	0,02
11.400	Shenghe Resources Holding Co Ltd 'A'	38.486	0,12
13.304	Shengyi Technology Co Ltd 'A'	33.765	0,11
1.904	Shennan Circuits Co Ltd	26.653	0,08
62.100	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd	39.796	0,12
4.400	Shenzhen Airport Co Ltd	5.074	0,02
5.220	Shenzhen Capchem Technology Co Ltd	40.985	0,13
720	Shenzhen Dynanonic Co Ltd	43.955	0,14
5.600	Shenzhen Energy Group Co Ltd	5.362	0,02
14.300	Shenzhen Fastprint Circuit Tech Co Ltd	24.074	0,08
1.600	Shenzhen Goodix Technology Co Ltd 'A'	14.802	0,05
13.750	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	135.296	0,42
9.700	Shenzhen Jinjia Group Co Ltd	15.533	0,05
7.700	Shenzhen Kaifa Technology Co Ltd	13.389	0,04
5.920	Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd	39.954	0,13
1.400	Shenzhen Kedali Industry Co Ltd	33.252	0,10
3.900	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	182.466	0,57
34.500	Shenzhen MTC Co Ltd	19.790	0,06
2.600	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co Ltd	17.520	0,05
34.426	Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd	33.375	0,10
2.900	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co Ltd	12.173	0,04
1.700	Shenzhen SC New Energy Technology Corp	22.690	0,07
7.791	Shenzhen Senior Technology Material Co Ltd	33.797	0,11
6.800	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd	27.680	0,09

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
5.800	Shenzhen Sunway Communication Co Ltd	14.599	0,05
2.600	Shenzhen Transsion Holdings Co Ltd 'A'	34.656	0,11
3.200	Shenzhen YUTO Packaging Technology Co Ltd	14.125	0,04
11.043	Shenzhen Zhongjin Lingnan Nonfemet Co Ltd	7.357	0,02
12.820	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co Ltd	46.536	0,15
9.900	Siasun Robot & Automation Co Ltd	14.907	0,05
10.524	Sichuan Chuantou Energy Co Ltd 'A'	18.739	0,06
46.600	Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd 'A'	29.654	0,09
8.604	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd	24.035	0,08
8.100	Sichuan New Energy Power Co Ltd	26.801	0,08
20.532	Sichuan Road & Bridge Co Ltd 'A'	32.296	0,10
1.500	Sichuan Swellfun Co Ltd 'A'	20.736	0,06
11.000	Sichuan Yahua Industrial Group Co Ltd	53.650	0,17
4.400	Sieyuan Electric Co Ltd	23.438	0,07
15.885	Sinolink Securities Co Ltd 'A'	21.356	0,07
12.400	Sinoma International Engineering Co 'A'	17.949	0,06
4.300	Sinoma Science & Technology Co Ltd	17.664	0,06
2.660	Sinomine Resource Group Co Ltd	36.799	0,12
13.800	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'A'	6.555	0,02
1.200	Sinosoft Co Ltd 'A'	4.180	0,01
21.000	Sinotrans Ltd 'A'	12.172	0,04
1.500	Skshu Paint Co Ltd 'A'	29.002	0,09
13.860	Songcheng Performance Development Co Ltd	31.781	0,10
24.730	SooChow Securities Co Ltd 'A'	25.601	0,08
34.900	Southwest Securities Co Ltd 'A'	20.697	0,06
2.900	Spring Airlines Co Ltd 'A'	25.277	0,08
700	StarPower Semiconductor Ltd 'A'	40.352	0,13
8.600	Sungrow Power Supply Co Ltd	126.219	0,39
9.400	Sunwoda Electronic Co Ltd	44.372	0,14
4.800	Suofeiya Home Collection Co Ltd	19.718	0,06

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
14.800	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd	50.694	0,16
16.588	Suzhou Gold Mantis Construction Decoration Co Ltd	12.588	0,04
512	Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd	37.545	0,12
2.400	Suzhou TA&A Ultra Clean Technology Co Ltd	31.334	0,10
10.500	Tangshan Jidong Cement Co Ltd	16.501	0,05
50.500	TangShan Port Group Co Ltd 'A'	19.463	0,06
10.200	Tangshan Sanyou Chemical Industries Co Ltd 'A'	12.479	0,04
5.925	Tasly Pharmaceutical Group Co Ltd 'A'	9.302	0,03
22.938	TBEA Co Ltd 'A'	93.852	0,29
102.637	TCL Technology Group Corp	73.440	0,23
18.200	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd	160.106	0,50
2.600	Thunder Software Technology Co Ltd	50.677	0,16
38.300	Tianfeng Securities Co Ltd 'A'	18.194	0,06
2.400	Tianjin 712 Communication & Broadcasting Co Ltd 'A'	11.293	0,04
15.300	Tianma Microelectronics Co Ltd	22.787	0,07
9.660	Tianqi Lithium Corp	180.089	0,56
13.100	Tianshan Aluminum Group Co Ltd	12.778	0,04
16.489	Tianshui Huatian Technology Co Ltd	23.104	0,07
3.900	Tibet Mineral Development Co	32.584	0,10
3.200	Tibet Summit Resources Co Ltd 'A'	13.719	0,04
6.400	Titan Wind Energy Suzhou Co Ltd	15.765	0,05
5.292	Toly Bread Co Ltd 'A'	13.083	0,04
5.000	TongFu Microelectronics Co Ltd	11.502	0,04
8.000	Tonghua Dongbao Pharmaceutical Co Ltd 'A'	12.357	0,04
14.880	Tongkun Group Co Ltd 'A'	35.298	0,11
49.000	Tongling Nonferrous Metals Group Co Ltd	23.862	0,07
22.200	Tongwei Co Ltd 'A'	198.511	0,62
1.600	Topchoice Medical Corp 'A'	41.693	0,13
3.600	Topsec Technologies Group Inc	5.458	0,02

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
10.600	Transfar Zhilian Co Ltd	10.181	0,03
4.700	Trina Solar Co Ltd 'A'	45.811	0,14
24.450	Tsinghua Tongfang Co Ltd 'A'	16.253	0,05
2.000	Tsingtao Brewery Co Ltd 'A'	31.047	0,10
3.600	Unigroup Guoxin Microelectronics Co Ltd	102.026	0,32
11.886	Unisplendour Corp Ltd	34.445	0,11
6.900	Venustech Group Inc	20.542	0,06
1.500	Verisilicon Microelectronics Shanghai Co Ltd 'A'	11.069	0,03
12.400	Walvax Biotechnology Co Ltd	89.634	0,28
12.100	Wanda Film Holding Co Ltd	24.672	0,08
2.300	Wangfujing Group Co Ltd 'A'	8.926	0,03
23.900	Wangsu Science & Technology Co Ltd	19.136	0,06
12.100	Wanhua Chemical Group Co Ltd 'A'	175.310	0,55
11.214	Wanxiang Qianchao Co Ltd	9.950	0,03
53.600	Weichai Power Co Ltd	99.845	0,31
5.400	Weifu High-Technology Group Co Ltd	15.528	0,05
1.900	Weihai Guangwei Composites Co Ltd	16.709	0,05
37.820	Wens Foodstuffs Group Co Ltd	120.279	0,38
15.932	Western Mining Co Ltd 'A'	28.155	0,09
14.334	Western Securities Co Ltd	14.004	0,04
1.500	Western Superconducting Technologies Co Ltd 'A'	20.659	0,06
5.440	Westone Information Industry Inc	34.870	0,11
4.300	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai 'A'	111.144	0,35
4.800	Wingtech Technology Co Ltd 'A'	61.026	0,19
10.690	Winning Health Technology Group Co Ltd	14.021	0,04
134.000	Wintime Energy Co Ltd 'A'	31.827	0,10
11.075	Wuchan Zhongda Group Co Ltd 'A'	8.487	0,03
8.641	Wuhan Guide Infrared Co Ltd	16.613	0,05
2.200	Wuhan Raycus Fiber Laser Technologies Co Ltd	12.784	0,04

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
18.100	Wuhu Token Science Co Ltd	20.062	0,06
15.825	Wuliangye Yibin Co Ltd	477.352	1,49
9.630	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd	21.233	0,07
16.756	WuXi AppTec Co Ltd 'A'	260.289	0,81
9.200	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	86.828	0,27
1.400	Wuxi Shangji Automation Co Ltd 'A'	32.623	0,10
16.500	Wuxi Taiji Industry Co Ltd 'A'	18.190	0,06
65.120	XCMG Construction Machinery Co Ltd	52.432	0,16
9.157	Xiamen C & D Inc 'A'	17.878	0,06
1.200	Xiamen Faratronic Co Ltd 'A'	36.776	0,12
18.800	Xiamen ITG Group Corp Ltd 'A'	21.063	0,07
1.500	Xiamen Kingdomway Group Co	5.342	0,02
6.100	Xiamen Tungsten Co Ltd 'A'	19.701	0,06
2.300	Xi'an Triangle Defense Co Ltd	16.543	0,05
23.728	Xinhu Zhongbao Co Ltd 'A'	9.783	0,03
19.518	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	43.151	0,14
17.700	Xinjiang Zhongtai Chemical Co Ltd	20.518	0,06
8.169	Xinxing Ductile Iron Pipes Co Ltd	5.882	0,02
8.500	Xinyangfeng Agricultural Technology Co Ltd	21.446	0,07
22.900	Xinyu Iron & Steel Co Ltd 'A'	17.241	0,05
7.299	Xuji Electric Co Ltd	20.934	0,07
3.200	Yangzhou Yangjie Electronic Technology Co Ltd	34.059	0,11
7.900	Yankuang Energy Group Co Ltd 'A'	46.591	0,15
4.460	Yantai Jereh Oilfield Services Group Co Ltd	26.849	0,08
3.050	Yealink Network Technology Corp Ltd	34.695	0,11
13.000	Yifan Pharmaceutical Co Ltd	27.148	0,09
3.790	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd 'A'	29.910	0,09
4.700	Yihai Kerry Arawana Holdings Co Ltd	37.927	0,12

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
12.724	Yintai Gold Co Ltd	18.513	0,06
3.200	Yixintang Pharmaceutical Group Co Ltd	10.961	0,03
39.894	Yonghui Superstores Co Ltd 'A'	25.506	0,08
1.700	YongXing Special Materials Technology Co Ltd	38.653	0,12
13.270	Yonyou Network Technology Co Ltd 'A'	43.035	0,13
24.920	Youngor Group Co Ltd 'A'	24.681	0,08
1.700	Youngy Co Ltd	39.032	0,12
12.000	YTO Express Group Co Ltd 'A'	36.550	0,11
10.190	Yuan Longping High-tech Agriculture Co Ltd	25.360	0,08
9.610	Yunda Holding Co Ltd	24.490	0,08
12.900	Yunnan Aluminium Co Ltd	19.039	0,06
6.476	Yunnan Baiyao Group Co Ltd	58.421	0,18
22.700	Yunnan Chihong Zinc&Germanium Co Ltd 'A'	17.599	0,06
12.136	Yunnan Copper Co Ltd	20.649	0,06
4.100	Yunnan Energy New Material Co Ltd	153.391	0,48
9.396	Yunnan Tin Co Ltd	23.538	0,07
8.300	Yunnan Yuntianhua Co Ltd 'A'	39.031	0,12
12.876	Yutong Bus Co Ltd 'A'	16.638	0,05
4.300	Zangge Mining Co Ltd	21.159	0,07
2.000	Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co Ltd 'A'	106.577	0,33
29.300	Zhefu Holding Group Co Ltd	20.965	0,07
64.800	Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	46.657	0,15
900	Zhejiang Cfmoto Power Co Ltd 'A'	15.289	0,05
31.700	Zhejiang China Commodities City Group Co Ltd 'A'	26.376	0,08
8.200	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd 'A'	43.828	0,14
7.200	Zhejiang Crystal-Optech Co Ltd	13.025	0,04
2.240	Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd 'A'	16.965	0,05
4.500	Zhejiang Hailiang Co Ltd	7.764	0,02

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
1.200	Zhejiang HangKe Technology Inc Co 'A'	12.559	0,04
80	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd 'A'	271	0,00
10.728	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd 'A'	153.236	0,48
13.800	Zhejiang Jiahua Energy Chemical Industry Co Ltd 'A'	22.387	0,07
5.400	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	54.522	0,17
3.300	Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co Ltd 'A'	25.486	0,08
14.156	Zhejiang Juhua Co Ltd 'A'	27.807	0,09
20.300	Zhejiang Longsheng Group Co Ltd 'A'	30.870	0,10
3.868	Zhejiang Medicine Co Ltd 'A'	7.887	0,02
14.062	Zhejiang NHU Co Ltd	47.914	0,15
840	Zhejiang Orient Gene Biotech Co Ltd 'A'	14.324	0,04
17.312	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	71.065	0,22
14.700	Zhejiang Semir Garment Co Ltd	13.000	0,04
1.300	Zhejiang Supcon Technology Co Ltd 'A'	14.130	0,04
2.400	Zhejiang Supor Co Ltd	20.199	0,06
1.600	Zhejiang Weiming Environment Protection Co Ltd 'A'	7.976	0,03
6.600	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd	23.701	0,07
1.200	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd	9.327	0,03
3.900	Zhejiang Yongtai Technology Co Ltd	19.185	0,06
54.600	Zhejiang Zheneng Electric Power Co Ltd 'A'	28.302	0,09
9.100	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'A'	19.588	0,06
10.400	Zheshang Securities Co Ltd 'A'	17.679	0,06
3.700	Zhongji Innolight Co Ltd	17.162	0,05
19.171	Zhongjin Gold Corp Ltd 'A'	21.163	0,07
12.600	Zhongtai Securities Co Ltd 'A'	14.399	0,05
41.900	Zhongtian Financial Group Co Ltd	12.080	0,04
800	Zhuzhou Hongda Electronics Corp Ltd	7.310	0,02
13.900	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd 'A'	26.474	0,08

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 96,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (30. Juni 2021: 96,33 %) (Fortsetzung)</b>			
10.400	Zibo Qixiang Tengda Chemical Co Ltd	12.599	0,04
117.436	Zijin Mining Group Co Ltd 'A'	163.673	0,51
69.686	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	64.124	0,20
23.600	ZTE Corp	90.003	0,28
	<b>China insgesamt</b>	<b>31.623.106</b>	<b>98,89</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>31.667.664</b>	<b>99,03</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	31.667.664	99,03
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	310.599	0,97
		<b>31.978.263</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		98,96
	Sonstige Vermögenswerte		1,04
			<b>100,00</b>
	Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

## L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2021: 93,99 %)</b>					
505.000	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.07.2022	505.000	1,81
555.000	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	555.000	1,98
950.000	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.07.2022	950.000	3,39
25.066.328	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	25.066.328	89,49
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>27.076.328</b>	<b>96,67</b>

Nominal	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust €	% des Nettover- mögens	
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2021: (0,96 %))</b>				
30.053.441	LevDAX® x2 Index1	21.07.2022	(2.098.885)	(7,49)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten</b>			<b>(2.098.885)</b>	<b>(7,49)</b>

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens	
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2021: 7,02 %)</b>				
13.689	BlackRock Institutional Euro Cash Plus Fund	1.343.357	4,80	
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>1.343.357</b>	<b>4,80</b>

<b>Gesamtanlagen</b>			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		27.076.328	96,67
Geldmarktinstrumente		1.343.357	4,80
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten		(2.098.885)	(7,49)
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.688.469	6,02
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>28.009.269</b>	<b>100,00</b>

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden			4,32
Einlagen bei Kreditinstituten			87,13
Sonstige Vermögenswerte			8,55
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Merrill Lynch International.

## L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2021: 92,20 %)</b>					
1.881.000	Merrill Lynch International	(0,51) %	22.07.2022	1.881.000	4,23
34.893.800	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	34.893.800	78,46
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>36.774.800</b>	<b>82,69</b>

Nominal	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn €	% des Nettover- mögens	
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2021: (0,77 %))</b>				
41.558.387	ShortDAX® x2 Index1	21.07.2022	2.851.623	6,41
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>			<b>2.851.623</b>	<b>6,41</b>

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens	
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2021: 5,86 %)</b>				
29.847	BlackRock Institutional Euro Cash Plus Fund	2.929.038	6,59	
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>2.929.038</b>	<b>6,59</b>

<b>Gesamtanlagen</b>			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		36.774.800	82,69
Geldmarktinstrumente		2.929.038	6,59
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten		2.851.623	6,41
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.915.724	4,31
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>44.471.185</b>	<b>100,00</b>

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden			6,37
Einlagen bei Kreditinstituten			80,01
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente			6,20
Sonstige Vermögenswerte			7,42
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Merrill Lynch International.

## L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2021: 90,14 %)</b>					
4.770.000	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	4.770.000	0,72
618.668.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	618.668.724	94,00
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>623.438.724</b>	<b>94,72</b>

Nominal	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens	
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2021: 3,09 %)</b>				
703.390.317	Dow Jones-UBS Commodity Index Total Return1	21.07.2022	(44.009.038)	(6,69)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten</b>			<b>(44.009.038)</b>	<b>(6,69)</b>

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2021: 8,46 %)</b>			
49.574.992	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund	49.574.992	7,53
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>		<b>49.574.992</b>	<b>7,53</b>

<b>Gesamtanlagen</b>			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		623.438.724	94,72
Geldmarktinstrumente		49.574.992	7,53
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten		(44.009.038)	(6,69)
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		29.155.549	4,44
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>658.160.227</b>	<b>100,00</b>

**L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2022

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	7,05
Einlagen bei Kreditinstituten	88,70
Sonstige Vermögenswerte	4,25
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

## L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2021: 92,69 %)</b>					
366.153	Merrill Lynch International	1,18 %	22.07.2022	366.153	2,04
2.036.000	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	2.036.000	11,35
13.757.604	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	13.757.604	76,65
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>16.159.757</b>	<b>90,04</b>
Nominal	Beschreibung			Nicht realisierter Gewinn £	% des Nettover- mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2021: (0,69 %))</b>					
17.606.481	FTSE 100® Leveraged Index <sup>1</sup>		21.07.2022	278.323	1,55
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>				<b>278.323</b>	<b>1,55</b>
Nominal	Beschreibung			Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2021: 9,48 %)</b>					
2.573.265	BlackRock Institutional Sterling Cash Plus Fund			2.573.265	14,34
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				<b>2.573.265</b>	<b>14,34</b>
<b>Gesamtanlagen</b>					
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				16.159.757	90,04
Geldmarktinstrumente				2.573.265	14,34
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten				278.323	1,55
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				(1.063.340)	(5,93)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>17.948.005</b>	<b>100,00</b>

**L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2022

	% des Gesamt- vermö- gens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	13,53
Einlagen bei Kreditinstituten	84,98
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente	1,46
Sonstige Vermögenswerte	0,03
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Merrill Lynch International.

## L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2021: 84,57 %)</b>					
275.000	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	275.000	2,39
10.168.751	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	10.168.751	88,53
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>10.443.751</b>	<b>90,92</b>

Nominal	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust £	% des Nettover- mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2021: 0,43 %)</b>			
11.667.469	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index <sup>1</sup>	(202.833)	(1,77)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten</b>			<b>(202.833)</b>
			<b>(1,77)</b>

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2021: 4,78 %)</b>			
787.364	BlackRock Institutional Sterling Cash Plus Fund	787.364	6,85
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>		<b>787.364</b>	<b>6,85</b>

<b>Gesamtanlagen</b>			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		10.443.751	90,92
Geldmarktinstrumente		787.364	6,85
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten		(202.833)	(1,77)
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		458.405	4,00
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>11.486.687</b>	<b>100,00</b>

**L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2022

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	6,73
Einlagen bei Kreditinstituten	89,25
Sonstige Vermögenswerte	4,02
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Merrill Lynch International.

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %)</b>			
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 1,52 %)</b>			
285	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	9.502	0,03
328	Argo Group International Holdings Ltd	12.090	0,04
597	Bank of NT Butterfield & Son Ltd/The	18.620	0,06
144	Enstar Group Ltd	30.813	0,09
2.970	Essent Group Ltd	115.533	0,34
1.949	Frontline Ltd/Bermuda	17.268	0,05
1.461	Golar LNG Ltd	33.238	0,10
257	Helen of Troy Ltd	41.739	0,12
2.256	Liberty Latin America Ltd	17.574	0,05
106	Nabors Industries Ltd	14.193	0,04
1.414	SFL Corp Ltd	13.419	0,04
1.362	Signet Jewelers Ltd	72.813	0,22
643	Textainer Group Holdings Ltd	17.625	0,05
993	Triton International Ltd	52.282	0,15
738	Valaris Ltd	31.173	0,09
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>497.882</b>	<b>1,47</b>
<b>Britische Jungferninseln (30. Juni 2021: 0,10 %)</b>			
612	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	89.175	0,26
	<b>Britische Jungferninseln insgesamt</b>	<b>89.175</b>	<b>0,26</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 0,78 %)</b>			
5.485	AbCellera Biologics Inc	58.415	0,17
1.906	Aurinia Pharmaceuticals Inc	19.155	0,06
1.674	Brookfield Infrastructure Corp - Class A	71.145	0,21
1.984	Energy Fuels Inc/Canada	9.741	0,03
454	IMAX Corp	7.668	0,02
2.500	Lions Gate Entertainment Corp	22.075	0,06

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Kanada (30. Juni 2021: 0,78 %) (Fortsetzung)</b>			
391	Masonite International Corp	30.041	0,09
2.683	Novagold Resources Inc	12.905	0,04
436	Novanta Inc	52.874	0,15
1.984	Primo Water Corp	26.546	0,08
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>310.565</b>	<b>0,91</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,39 %)</b>			
546	Ambarella Inc	35.741	0,11
655	Fabrinet	53.121	0,16
346	Fresh Del Monte Produce Inc	10.217	0,03
2.071	Herbalife Nutrition Ltd	42.352	0,12
4.892	StoneCo Ltd - Class A	37.668	0,11
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>179.099</b>	<b>0,53</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 0,07 %)</b>			
2.032	Constellium SE - Class A	26.843	0,08
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>26.843</b>	<b>0,08</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 0,49 %)</b>			
833	Adient Plc	24.682	0,07
2.720	Alkermes Plc	81.029	0,24
1.580	Prothena Corp Plc	42.897	0,13
458	Trinseo Plc	17.615	0,05
978	Weatherford International Plc	20.704	0,06
<b>Irland insgesamt</b>		<b>186.927</b>	<b>0,55</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 0,09 %)</b>			
1.091	Orion Engineered Carbons SA	16.943	0,05
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>16.943</b>	<b>0,05</b>

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Marshallinseln (30. Juni 2021: 0,08 %)</b>			
342	Eagle Bulk Shipping Inc	17.743	0,05
1.013	Genco Shipping & Trading Ltd	19.571	0,06
761	Scorpio Tankers Inc	26.262	0,08
<b>Marshallinseln insgesamt</b>		<b>63.576</b>	<b>0,19</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 0,03 %)</b>			
622	Expro Group Holdings NV	7.165	0,02
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>7.165</b>	<b>0,02</b>
<b>Puerto Rico (30. Juni 2021: 0,26 %)</b>			
1.091	EVERTEC Inc	40.236	0,12
3.064	First BanCorp/Puerto Rico	39.556	0,12
1.114	OFG Bancorp	28.296	0,08
<b>Puerto Rico insgesamt</b>		<b>108.088</b>	<b>0,32</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 0,51 %)</b>			
2.462	Cushman & Wakefield Plc	37.521	0,11
1.086	International Game Technology Plc	20.156	0,06
945	LivaNova Plc	59.034	0,17
2.338	Tronox Holdings Plc	39.279	0,12
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>155.990</b>	<b>0,46</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %)</b>			
646	1Life Healthcare Inc	5.065	0,01
200	1st Source Corp	9.080	0,03
902	3D Systems Corp	8.749	0,03
1.218	A10 Networks Inc	17.515	0,05
607	AAON Inc	33.239	0,10

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
327	AAR Corp	13.682	0,04
941	Aaron's Co Inc/The	13.692	0,04
1.151	Abercrombie & Fitch Co	19.475	0,06
970	ABM Industries Inc	42.117	0,12
1.907	Academy Sports & Outdoors Inc	67.775	0,20
2.448	ACADIA Pharmaceuticals Inc	34.492	0,10
990	Acadia Realty Trust (REIT)	15.464	0,05
2.316	Accel Entertainment Inc - Class A	24.596	0,07
1.763	ACI Worldwide Inc	45.644	0,13
869	Acushnet Holdings Corp	36.220	0,11
813	AdaptHealth Corp - Class A	14.667	0,04
3.084	Adaptive Biotechnologies Corp	24.950	0,07
312	Addus HomeCare Corp	25.983	0,08
656	Adtalem Global Education Inc	23.596	0,07
937	ADTRAN Inc	16.426	0,05
634	Advanced Energy Industries Inc	46.269	0,14
392	AdvanSix Inc	13.108	0,04
1.500	Aerojet Rocketdyne Holdings Inc	60.900	0,18
295	AeroVironment Inc	24.249	0,07
7.023	Agenus Inc	13.625	0,04
229	Agilysys Inc	10.825	0,03
929	Agree Realty Corp (REIT)	67.009	0,20
822	Air Transport Services Group Inc	23.616	0,07
183	Alamo Group Inc	21.307	0,06
770	Alarm.com Holdings Inc	47.632	0,14
598	Albany International Corp - Class A	47.116	0,14
1.520	Alector Inc	15.443	0,05
951	Alexander & Baldwin Inc (REIT)	17.070	0,05

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
31	Alexander's Inc (REIT)	6.887	0,02
3.067	Alight Inc	20.702	0,06
234	Allegiance Bancshares Inc	8.836	0,03
291	Allegiant Travel Co	32.909	0,10
1.007	ALLETE Inc	59.191	0,17
907	Allogene Therapeutics Inc	10.340	0,03
2.010	Allscripts Healthcare Solutions Inc	29.808	0,09
351	Alpha Metallurgical Resources Inc	45.325	0,13
802	Altair Engineering Inc - Class A	42.105	0,12
865	Altra Industrial Motion Corp	30.491	0,09
411	AMC Networks Inc	11.968	0,04
406	Ameresco Inc - Class A	18.497	0,05
619	American Assets Trust Inc (REIT)	18.384	0,05
2.568	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	19.337	0,06
3.295	American Eagle Outfitters Inc	36.838	0,11
1.015	American Equity Investment Life Holding Co	37.119	0,11
680	American Software Inc/GA	10.989	0,03
682	American States Water Co	55.590	0,16
599	American Vanguard Corp	13.388	0,04
4.966	American Well Corp - Class A	21.453	0,06
487	American Woodmark Corp	21.920	0,06
1.028	Ameris Bancorp	41.305	0,12
331	AMERISAFE Inc	17.215	0,05
2.767	Amicus Therapeutics Inc	29.718	0,09
2.174	Amkor Technology Inc	36.849	0,11
955	AMN Healthcare Services Inc	104.773	0,31
1.259	Amphastar Pharmaceuticals Inc	43.801	0,13
706	AnaptysBio Inc	14.332	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
674	Anavex Life Sciences Corp	6.747	0,02
758	Andersons Inc/The	25.006	0,07
525	AngioDynamics Inc	10.159	0,03
322	Anika Therapeutics Inc	7.187	0,02
224	Anterix Inc	9.200	0,03
1.012	Anywhere Real Estate Inc	9.948	0,03
1.797	Apartment Investment and Management Co (REIT)	11.501	0,03
372	Apellis Pharmaceuticals Inc	16.822	0,05
2.427	API Group Corp	36.332	0,11
493	Apogee Enterprises Inc	19.335	0,06
1.684	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT)	17.581	0,05
1.018	Apollo Medical Holdings Inc	39.285	0,12
385	Appfolio Inc	34.896	0,10
897	Appian Corp - Class A	42.482	0,13
2.312	Apple Hospitality REIT Inc (REIT)	33.917	0,10
586	Applied Industrial Technologies Inc	56.356	0,17
1.667	Arbor Realty Trust Inc (REIT)	21.854	0,06
681	ArcBest Corp	47.922	0,14
285	Arch Resources Inc	40.781	0,12
2.192	Archrock Inc	18.128	0,05
1.109	Arconic Corp	31.107	0,09
531	Arcosa Inc	24.654	0,07
1.293	Arcus Biosciences Inc	32.765	0,10
470	Argan Inc	17.540	0,05
2.500	Arko Corp	20.400	0,06
1.407	Arlo Technologies Inc	8.822	0,03
1.069	Armada Hoffer Properties Inc (REIT)	13.726	0,04
1.079	Array Technologies Inc	11.880	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
2.252	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	79.293	0,23
4.808	Artisan Partners Asset Management Inc - Class A	171.021	0,50
584	Artivion Inc	11.026	0,03
737	Arvinas Inc	31.020	0,09
142	Asbury Automotive Group Inc	24.046	0,07
732	ASGN Inc	66.063	0,19
2.246	Associated Banc-Corp	41.012	0,12
327	Astec Industries Inc	13.335	0,04
3.436	Atea Pharmaceuticals Inc	24.396	0,07
1.531	ATI Inc	34.769	0,10
1.341	Atkore Inc	111.316	0,33
1.110	Atlantic Union Bankshares Corp	37.651	0,11
482	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	29.744	0,09
555	AtriCure Inc	22.677	0,07
44	Atrion Corp	27.670	0,08
1.140	Avanos Medical Inc	31.168	0,09
4.310	AvePoint Inc	18.705	0,06
1.731	Avid Bioservices Inc	26.415	0,08
927	Avid Technology Inc	24.056	0,07
1.400	Avient Corp	56.112	0,17
952	Avista Corp	41.422	0,12
1.071	Axcelis Technologies Inc	58.734	0,17
778	Axos Financial Inc	27.891	0,08
311	AZZ Inc	12.695	0,04
416	B Riley Financial Inc	17.576	0,05
816	B&G Foods Inc	19.404	0,06
726	Badger Meter Inc	58.726	0,17
584	Balchem Corp	75.768	0,22

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
242	Bally's Corp	4.787	0,01
641	Banc of California Inc	11.294	0,03
223	BancFirst Corp	21.343	0,06
899	Bancorp Inc/The	17.548	0,05
764	BankUnited Inc	27.175	0,08
407	Banner Corp	22.877	0,07
551	Barnes Group Inc	17.158	0,05
740	Beacon Roofing Supply Inc	38.006	0,11
908	Beauty Health Co/The	11.677	0,03
655	Belden Inc	34.892	0,10
2.343	BellRing Brands Inc	58.317	0,17
533	Benchmark Electronics Inc	12.024	0,04
469	Berkshire Hills Bancorp Inc	11.617	0,03
607	Beyond Meat Inc	14.532	0,04
4.150	BGC Partners Inc - Class A	13.986	0,04
988	Big Lots Inc	20.718	0,06
189	BigCommerce Holdings Inc	3.062	0,01
2.075	BioCryst Pharmaceuticals Inc	21.954	0,06
189	BJ's Restaurants Inc	4.098	0,01
919	Black Hills Corp	66.876	0,20
565	Blackbaud Inc	32.810	0,10
730	Blackline Inc	48.618	0,14
2.220	Blackstone Mortgage Trust Inc (REIT) - Class A	61.427	0,18
1.444	Bloom Energy Corp	23.826	0,07
1.959	Bloomin' Brands Inc	32.559	0,10
237	BlueLinx Holdings Inc	15.834	0,05
665	Blueprint Medicines Corp	33.589	0,10
1.315	Boise Cascade Co	78.229	0,23

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
713	Boot Barn Holdings Inc	49.133	0,14
2.226	Box Inc	55.962	0,17
888	Brady Corp - Class A	41.949	0,12
1.850	Brandywine Realty Trust (REIT)	17.834	0,05
689	Bread Financial Holdings Inc	25.534	0,08
958	Bridgebio Pharma Inc	8.699	0,03
774	Brigham Minerals Inc - Class A	19.064	0,06
1.340	Brightsphere Investment Group Inc	24.133	0,07
864	Brinker International Inc	19.034	0,06
534	Brink's Co/The	32.419	0,10
2.414	Broadmark Realty Capital Inc (REIT)	16.198	0,05
2.272	Broadstone Net Lease Inc (REIT)	46.599	0,14
3.381	Brookdale Senior Living Inc	15.350	0,05
882	Brookline Bancorp Inc	11.739	0,03
672	BRP Group Inc - Class A	16.229	0,05
1.560	Buckle Inc/The	43.196	0,13
1.315	Bumble Inc - Class A	37.017	0,11
6.800	Butterfly Network Inc	20.876	0,06
909	Cabot Corp	57.985	0,17
834	Cactus Inc	33.585	0,10
2.365	Cadence Bank	55.530	0,16
429	Caleres Inc	11.257	0,03
2.120	California Resources Corp	81.620	0,24
663	California Water Service Group	36.830	0,11
1.139	Calix Inc	38.885	0,11
848	Callaway Golf Co	17.299	0,05
733	Callon Petroleum Co	28.734	0,08
641	Cal-Maine Foods Inc	31.672	0,09

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
848	Camping World Holdings Inc - Class A	18.308	0,05
817	Cannae Holdings Inc	15.801	0,05
2.782	Capitol Federal Financial Inc	25.539	0,08
1.296	CareDx Inc	27.838	0,08
2.036	CareTrust REIT Inc (REIT)	37.544	0,11
1.211	Cargurus Inc	26.024	0,08
806	Carpenter Technology Corp	22.495	0,07
1.028	Cars.com Inc	9.694	0,03
874	Casella Waste Systems Inc - Class A	63.522	0,19
994	Cassava Sciences Inc	27.951	0,08
3.345	Catalyst Pharmaceuticals Inc	23.448	0,07
1.580	CatchMark Timber Trust Inc (REIT) - Class A	15.895	0,05
1.141	Cathay General Bancorp	44.670	0,13
190	Cavco Industries Inc	37.238	0,11
870	CBIZ Inc	34.765	0,10
474	Celldex Therapeutics Inc	12.779	0,04
2.495	Centennial Resource Development Inc/DE - Class A	14.920	0,04
215	Centerspace (REIT)	17.533	0,05
646	Central Garden & Pet Co - Class A	25.846	0,08
473	Century Communities Inc	21.271	0,06
677	Cerence Inc	17.081	0,05
589	Cerevel Therapeutics Holdings Inc	15.573	0,05
2.956	Cerus Corp	15.637	0,05
473	CEVA Inc	15.874	0,05
4.099	ChampionX Corp	81.365	0,24
493	ChannelAdvisor Corp	7.188	0,02
451	Chart Industries Inc	75.488	0,22
225	Chase Corp	17.507	0,05

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.166	Cheesecake Factory Inc/The	30.806	0,09
644	Chefs' Warehouse Inc/The	25.045	0,07
1.576	Chegg Inc	29.597	0,09
268	Chesapeake Utilities Corp	34.719	0,10
3.574	Chico's FAS Inc	17.763	0,05
137	Children's Place Inc/The	5.332	0,02
4.903	Chimera Investment Corp (REIT)	43.244	0,13
894	Chinook Therapeutics Inc	15.636	0,05
439	Chord Energy Corp	53.404	0,16
254	Chuy's Holdings Inc	5.060	0,01
685	Cinemark Holdings Inc	10.289	0,03
173	Citi Trends Inc	4.091	0,01
340	City Holding Co	27.159	0,08
3.570	City Office REIT Inc (REIT)	46.231	0,14
630	Civitas Resources Inc	32.943	0,10
1.505	Claros Mortgage Trust Inc	25.209	0,07
2.233	Clean Energy Fuels Corp	10.004	0,03
227	Clearfield Inc	14.063	0,04
1.024	Clearway Energy Inc	35.676	0,11
629	Clearway Energy Inc - Class A	20.109	0,06
463	CMC Materials Inc	80.789	0,24
1.371	CNO Financial Group Inc	24.801	0,07
3.242	CNX Resources Corp	53.363	0,16
82	Coca-Cola Consolidated Inc	46.240	0,14
1.133	Codexis Inc	11.851	0,04
4.219	Coeur Mining Inc	12.826	0,04
698	Cogent Communications Holdings Inc	42.410	0,13
2.054	Cohen & Steers Inc	130.614	0,39

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.226	Cohu Inc (Units)	34.022	0,10
783	Collegium Pharmaceutical Inc	13.875	0,04
1.076	Columbia Banking System Inc	30.827	0,09
322	Columbus McKinnon Corp/NY	9.135	0,03
474	Comfort Systems USA Inc	39.413	0,12
1.487	Commercial Metals Co	49.220	0,15
3.461	CommScope Holding Co Inc	21.181	0,06
664	Community Bank System Inc	42.018	0,12
2.908	Community Health Systems Inc	10.905	0,03
460	Community Healthcare Trust Inc (REIT)	16.657	0,05
1.136	CommVault Systems Inc	71.454	0,21
816	Compass Diversified Holdings	17.479	0,05
506	Compass Minerals International Inc	17.907	0,05
1.673	Comstock Resources Inc	20.210	0,06
2.466	Conduent Inc	10.653	0,03
644	CONMED Corp	61.669	0,18
453	ConnectOne Bancorp Inc	11.076	0,03
378	Consensus Cloud Solutions Inc	16.511	0,05
577	CONSOL Energy Inc	28.492	0,08
435	Construction Partners Inc - Class A	9.109	0,03
12.675	ContextLogic Inc	20.280	0,06
4.669	Corcept Therapeutics Inc	111.029	0,33
1.989	CoreCivic Inc	22.098	0,07
711	Cornerstone Building Brands Inc	17.412	0,05
1.814	Corporate Office Properties Trust (REIT)	47.509	0,14
270	CorVel Corp	39.763	0,12
1.157	Coursera Inc	16.406	0,05
1.747	Covetrus Inc	36.250	0,11

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
382	Cowen Inc - Class A	9.050	0,03
147	CRA International Inc	13.130	0,04
493	Cracker Barrel Old Country Store Inc	41.161	0,12
655	Crinetics Pharmaceuticals Inc	12.216	0,04
3.452	Crocs Inc	168.009	0,50
531	CSG Systems International Inc	31.690	0,09
287	CSW Industrials Inc	29.570	0,09
722	CTS Corp	24.584	0,07
3.252	Cue Health Inc	10.406	0,03
425	Customers Bancorp Inc	14.408	0,04
1.527	CVB Financial Corp	37.885	0,11
879	CVR Energy Inc	29.447	0,09
507	Cytokinetics Inc	19.920	0,06
1.503	Dana Inc	21.147	0,06
1.088	Dave & Buster's Entertainment Inc	35.665	0,11
573	Deciphera Pharmaceuticals Inc	7.535	0,02
1.093	Delek US Holdings Inc	28.243	0,08
536	Deluxe Corp	11.615	0,03
1.689	Denali Therapeutics Inc	49.707	0,15
983	Denbury Inc	58.970	0,17
1.740	Designer Brands Inc	22.724	0,07
269	Diamond Hill Investment Group Inc	46.709	0,14
1.053	DiamondRock Hospitality Co (REIT)	8.645	0,03
1.099	Digi International Inc	26.618	0,08
831	Digital Turbine Inc	14.518	0,04
6.609	DigitalBridge Group Inc	32.252	0,10
970	DigitalOcean Holdings Inc	40.119	0,12
225	Dillard's Inc	49.628	0,15

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
509	Dime Community Bancshares Inc	15.092	0,04
234	Dine Brands Global Inc	15.229	0,04
1.210	Diodes Inc	78.130	0,23
525	Donnelley Financial Solutions Inc	15.377	0,05
316	Dorman Products Inc	34.668	0,10
346	Douglas Dynamics Inc	9.944	0,03
4.090	Douglas Elliman Inc	19.591	0,06
910	Dril-Quip Inc	23.478	0,07
1.599	Duck Creek Technologies Inc	23.745	0,07
169	Duolingo Inc	14.796	0,04
435	Dycom Industries Inc	40.472	0,12
5.783	Dynavax Technologies Corp	72.808	0,21
480	Dynex Capital Inc (REIT)	7.642	0,02
2.513	E2open Parent Holdings Inc	19.551	0,06
590	Eagle Bancorp Inc	27.972	0,08
281	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	12.485	0,04
1.121	Easterly Government Properties Inc (REIT) - Class A	21.344	0,06
2.043	Eastern Bankshares Inc	37.714	0,11
376	Ebix Inc	6.354	0,02
593	EchoStar Corp	11.445	0,03
692	Edgewell Personal Care Co	23.888	0,07
1.137	Editas Medicine Inc - Class A	13.451	0,04
602	elf Beauty Inc	18.469	0,05
1.164	Ellington Financial Inc (REIT)	17.076	0,05
3.626	Embecka Corp	91.810	0,27
1.046	EMCOR Group Inc	107.696	0,32
1.060	Emergent BioSolutions Inc	32.902	0,10
1.698	Empire State Realty Trust Inc (REIT)	11.937	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
418	Employers Holdings Inc	17.510	0,05
848	Enact Holdings Inc	18.215	0,05
576	Encore Capital Group Inc	33.276	0,10
885	Encore Wire Corp	91.969	0,27
648	Energizer Holdings Inc	18.371	0,05
1.161	Energy Recovery Inc	22.547	0,07
683	Enerpac Tool Group Corp - Class A	12.991	0,04
693	EnerSys	40.859	0,12
688	Ennis Inc	13.918	0,04
895	Enova International Inc	25.794	0,08
255	EnPro Industries Inc	20.892	0,06
1.295	Ensign Group Inc/The	95.144	0,28
301	Enterprise Financial Services Corp	12.492	0,04
850	Envestnet Inc	44.855	0,13
346	ePlus Inc	18.380	0,05
4.941	Equitrans Midstream Corp	31.425	0,09
1.099	Equity Commonwealth (REIT)	30.255	0,09
392	ESCO Technologies Inc	26.801	0,08
2.151	Essential Properties Realty Trust Inc (REIT)	46.225	0,14
1.747	Eventbrite Inc	17.942	0,05
548	Everbridge Inc	15.284	0,05
784	Everi Holdings Inc	12.787	0,04
620	Evo Payments Inc - Class A	14.582	0,04
1.213	Evolent Health Inc - Class A	37.251	0,11
2.067	Evoqua Water Technologies Corp	67.198	0,20
747	ExlService Holdings Inc	110.056	0,32
5.756	eXp World Holdings Inc	67.748	0,20
1.150	Exponent Inc	105.191	0,31

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.092	Extreme Networks Inc	9.741	0,03
1.490	Fastly Inc	17.299	0,05
1.424	Fate Therapeutics Inc	35.287	0,10
491	FB Financial Corp	19.257	0,06
90	Federal Agricultural Mortgage Corp	8.789	0,03
925	Federal Signal Corp	32.930	0,10
2.617	Federated Hermes Inc	83.194	0,25
347	First Bancorp/Southern Pines NC	12.110	0,04
567	First Busey Corp	12.956	0,04
2.151	First Commonwealth Financial Corp	28.866	0,09
1.800	First Financial Bancorp	34.920	0,10
2.023	First Financial Bankshares Inc	79.443	0,23
455	First Foundation Inc	9.318	0,03
1.035	First Interstate BancSystem Inc	39.444	0,12
934	First Merchants Corp	33.269	0,10
622	FirstCash Holdings Inc	43.235	0,13
1.542	Fisker Inc	13.215	0,04
704	Flagstar Bancorp Inc	24.957	0,07
600	FLEX LNG Ltd	16.434	0,05
1.039	Fluor Corp	25.289	0,07
541	Focus Financial Partners Inc - Class A	18.426	0,05
1.497	Foot Locker Inc	37.799	0,11
1.565	FormFactor Inc	60.612	0,18
413	Forrester Research Inc	19.758	0,06
709	Forward Air Corp	65.200	0,19
1.516	Four Corners Property Trust Inc (REIT)	40.310	0,12
658	Fox Factory Holding Corp	52.995	0,16
245	Franchise Group Inc	8.592	0,03

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.535	Franklin BSP Realty Trust Inc (REIT)	20.692	0,06
984	Franklin Electric Co Inc	72.088	0,21
1.630	Frontdoor Inc	39.250	0,12
732	Fulgent Genetics Inc	39.916	0,12
2.364	Fulton Financial Corp	34.160	0,10
673	Funko Inc - Class A	15.021	0,04
437	GAMCO Investors Inc	9.133	0,03
491	GATX Corp	46.233	0,14
282	GCP Applied Technologies Inc	8.821	0,03
216	Genesco Inc	10.781	0,03
799	Gentherm Inc	49.866	0,15
8.229	Genworth Financial Inc - Class A	29.048	0,09
1.745	GEO Group Inc/The	11.517	0,03
289	German American Bancorp Inc	9.878	0,03
749	Getty Realty Corp (REIT)	19.849	0,06
965	Gibraltar Industries Inc	37.394	0,11
370	G-III Apparel Group Ltd	7.485	0,02
1.650	Glacier Bancorp Inc	78.243	0,23
872	Gladstone Commercial Corp (REIT)	16.428	0,05
795	Glaukos Corp	36.109	0,11
847	Global Blood Therapeutics Inc	27.062	0,08
383	Global Industrial Co	12.934	0,04
547	Global Medical REIT Inc (REIT)	6.143	0,02
1.824	Global Net Lease Inc (REIT)	25.828	0,08
7.373	Globalstar Inc	9.069	0,03
639	GMS Inc	28.436	0,08
680	Gogo Inc	11.009	0,03
502	Golden Entertainment Inc	19.854	0,06

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
2.331	Golden Ocean Group Ltd	27.133	0,08
3.590	Goodyear Tire & Rubber Co/The	38.449	0,11
390	Goosehead Insurance Inc	17.811	0,05
1.294	GoPro Inc - Class A	7.156	0,02
364	Gorman-Rupp Co/The	10.301	0,03
2.112	GrafTech International Ltd	14.932	0,04
52	Graham Holdings Co	29.476	0,09
454	Granite Construction Inc	13.230	0,04
882	Gray Television Inc	14.897	0,04
1.070	Great Lakes Dredge & Dock Corp	14.028	0,04
810	Green Dot Corp - Class A	20.339	0,06
490	Green Plains Inc	13.313	0,04
426	Greenbrier Cos Inc/The	15.332	0,05
361	Greif Inc	22.519	0,07
1.022	Grid Dynamics Holdings Inc	17.190	0,05
551	Griffon Corp	15.445	0,05
343	Group 1 Automotive Inc	58.241	0,17
423	Guess? Inc	7.212	0,02
293	Gulfport Energy Corp	23.296	0,07
415	H&E Equipment Services Inc	12.023	0,04
978	Hackett Group Inc/The	18.553	0,05
784	Haemonetics Corp	51.101	0,15
1.199	Hain Celestial Group Inc/The	28.464	0,08
4.260	Halozyme Therapeutics Inc	187.440	0,55
1.341	Hamilton Lane Inc - Class A	90.088	0,27
1.049	Hancock Whitney Corp	46.502	0,14
1.268	Hanger Inc	18.158	0,05
1.325	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT)	50.165	0,15

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.155	Harmonic Inc	10.014	0,03
727	Harmony Biosciences Holdings Inc	35.456	0,10
1.010	Harsco Corp	7.181	0,02
262	Haverty Furniture Cos Inc	6.073	0,02
499	Hawkins Inc	17.979	0,05
809	HB Fuller Co	48.710	0,14
2.428	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	66.042	0,19
1.995	Healthcare Services Group Inc	34.733	0,10
1.116	HealthEquity Inc	68.511	0,20
651	HealthStream Inc	14.133	0,04
958	Heartland Express Inc	13.326	0,04
689	Heartland Financial USA Inc	28.621	0,08
9.074	Hecla Mining Co (Units)	35.570	0,10
362	Heidrick & Struggles International Inc	11.714	0,03
423	Helios Technologies Inc	28.024	0,08
2.086	Helix Energy Solutions Group Inc	6.467	0,02
1.144	Helmerich & Payne Inc	49.261	0,15
391	Herc Holdings Inc	35.249	0,10
904	Heritage Financial Corp/WA	22.745	0,07
285	Heritage-Crystal Clean Inc	7.684	0,02
117	Heska Corp	11.058	0,03
665	Hibbett Inc	29.067	0,09
1.316	Hillenbrand Inc	53.903	0,16
1.597	Hillman Solutions Corp	13.798	0,04
1.190	Hilltop Holdings Inc	31.725	0,09
884	Hilton Grand Vacations Inc	31.585	0,09
4.188	Hims & Hers Health Inc	18.972	0,06
753	HNI Corp	26.122	0,08

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
2.537	Home BancShares Inc/AR	52.693	0,16
227	HomeStreet Inc	7.870	0,02
1.345	Hope Bancorp Inc	18.615	0,05
477	Horace Mann Educators Corp	18.307	0,05
545	Horizon Bancorp Inc/IN	9.494	0,03
1.685	Hostess Brands Inc - Class A	35.739	0,11
1.865	Houlihan Lokey Inc - Class A	147.204	0,43
742	Hub Group Inc - Class A	52.637	0,16
367	Huron Consulting Group Inc	23.851	0,07
257	ICF International Inc	24.415	0,07
1.278	iHeartMedia Inc	10.083	0,03
396	Impinj Inc	23.233	0,07
1.403	Inari Medical Inc	95.390	0,28
2.742	Independence Realty Trust Inc (REIT)	56.842	0,17
730	Independent Bank Corp	57.984	0,17
653	Independent Bank Group Inc	44.345	0,13
1.286	Industrial Logistics Properties Trust (REIT)	18.107	0,05
1.956	Infinera Corp	10.484	0,03
654	Ingevity Corp	41.294	0,12
283	Ingles Markets Inc	24.550	0,07
404	Innospec Inc	38.699	0,11
595	Innovative Industrial Properties Inc (REIT)	65.373	0,19
1.756	Innoviva Inc	25.919	0,08
440	Inogen Inc	10.639	0,03
642	Insight Enterprises Inc	55.392	0,16
1.039	Insmid Inc	20.489	0,06
810	Insperity Inc	80.862	0,24
394	Inspire Medical Systems Inc	71.972	0,21

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
325	Installed Building Products Inc	27.027	0,08
326	Insteel Industries Inc	10.976	0,03
606	Integer Holdings Corp	42.820	0,13
1.001	Intellia Therapeutics Inc	51.812	0,15
206	Inter Parfums Inc	15.050	0,04
780	InterDigital Inc	47.424	0,14
833	Interface Inc - Class A	10.446	0,03
1.004	International Bancshares Corp	40.240	0,12
926	International Money Express Inc	18.955	0,06
2.021	Intra-Cellular Therapies Inc	115.359	0,34
297	Intrepid Potash Inc	13.451	0,04
861	InvenTrust Properties Corp (REIT)	22.205	0,07
112	Investors Title Co	17.572	0,05
293	iRhythm Technologies Inc	31.653	0,09
2.211	Iridium Communications Inc	83.045	0,24
643	iRobot Corp	23.630	0,07
2.794	Ironwood Pharmaceuticals Inc - Class A	32.215	0,10
757	iStar Inc (REIT)	10.378	0,03
1.889	iTeos Therapeutics Inc	38.913	0,11
571	Itron Inc	28.225	0,08
2.117	IVERIC bio Inc	20.366	0,06
294	J & J Snack Foods Corp	41.060	0,12
312	Jack in the Box Inc	17.491	0,05
964	Jackson Financial Inc	25.787	0,08
1.929	Janus International Group Inc	17.419	0,05
966	JELD-WEN Holding Inc	14.094	0,04
3.651	Joby Aviation Inc	17.926	0,05
186	John B Sanfilippo & Son Inc	13.483	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
467	John Bean Technologies Corp	51.566	0,15
563	John Wiley & Sons Inc	26.889	0,08
163	Kadant Inc	29.723	0,09
213	Kaiser Aluminum Corp	16.846	0,05
316	Kaman Corp	9.875	0,03
2.127	KAR Auction Services Inc	31.416	0,09
425	Karuna Therapeutics Inc	53.767	0,16
1.109	KB Home	31.562	0,09
746	Kearny Financial Corp/MD	8.288	0,02
479	Kelly Services Inc - Class A	9.499	0,03
847	Kennametal Inc	19.676	0,06
1.636	Kennedy-Wilson Holdings Inc	30.986	0,09
576	Kforce Inc	35.332	0,10
441	Kinsale Capital Group Inc	101.271	0,30
2.870	Kite Realty Group Trust (REIT)	49.622	0,15
992	KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT)	17.310	0,05
1.062	KnowBe4 Inc - Class A	16.588	0,05
1.278	Knowles Corp	22.148	0,07
1.075	Kontoor Brands Inc	35.873	0,11
978	Korn Ferry	56.744	0,17
6.117	Kosmos Energy Ltd	37.864	0,11
1.331	Kratos Defense & Security Solutions Inc	18.474	0,05
1.019	Krispy Kreme Inc	13.858	0,04
402	Krystal Biotech Inc	26.395	0,08
2.237	Kulicke & Soffa Industries Inc	95.766	0,28
1.158	Kura Oncology Inc	21.226	0,06
1.379	Ladder Capital Corp (REIT) - Class A	14.535	0,04
469	Lakeland Bancorp Inc	6.857	0,02

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
285	Lakeland Financial Corp	18.930	0,06
384	Lancaster Colony Corp	49.452	0,15
1.314	Lantheus Holdings Inc	86.763	0,26
192	Laredo Petroleum Inc	13.236	0,04
3.385	Laureate Education Inc - Class A	39.164	0,12
541	La-Z-Boy Inc	12.827	0,04
435	LCI Industries	48.668	0,14
439	LeMaitre Vascular Inc	19.996	0,06
1.488	LendingClub Corp	17.395	0,05
88	LendingTree Inc	3.856	0,01
318	LGI Homes Inc	27.634	0,08
359	LHC Group Inc	55.911	0,16
4.972	Liberty Energy Inc - Class A	63.443	0,19
646	Liberty Media Corp-Liberty Braves	15.504	0,05
350	Ligand Pharmaceuticals Inc (Units)	31.227	0,09
1.125	Light & Wonder Inc	52.864	0,16
148	Lindsay Corp	19.657	0,06
440	Liquidity Services Inc	5.914	0,02
393	Live Oak Bancshares Inc	13.319	0,04
1.774	Livent Corp	40.252	0,12
765	LivePerson Inc	10.817	0,03
1.105	LiveRamp Holdings Inc	28.520	0,08
736	LTC Properties Inc (REIT)	28.255	0,08
2.196	Luminar Technologies Inc - Class A	13.022	0,04
6.917	LXP Industrial Trust (REIT)	74.289	0,22
444	M/I Homes Inc	17.609	0,05
1.949	Macerich Co/The (REIT)	16.976	0,05
762	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	35.128	0,10

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
365	Madison Square Garden Entertainment Corp	19.206	0,06
284	Madrigal Pharmaceuticals Inc	20.329	0,06
976	Magnite Inc	8.667	0,03
5.305	Magnolia Oil & Gas Corp - Class A	111.352	0,33
297	Malibu Boats Inc - Class A	15.655	0,05
444	ManTech International Corp/VA - Class A	42.380	0,13
1.021	Marcus & Millichap Inc	37.767	0,11
551	MarineMax Inc	19.902	0,06
3.373	Marqeta Inc	27.355	0,08
1.178	Marten Transport Ltd	19.814	0,06
2.277	Matador Resources Co	106.085	0,31
192	Materion Corp	14.156	0,04
478	Mativ Inc	12.007	0,04
1.332	Matson Inc	97.076	0,29
482	Matthews International Corp	13.819	0,04
1.333	Maxar Technologies Inc	34.778	0,10
463	Maximus Inc	28.942	0,09
1.863	MaxLinear Inc	63.305	0,19
354	McGrath RentCorp	26.904	0,08
712	MDC Holdings Inc	23.005	0,07
523	Medifast Inc	94.407	0,28
825	Medpace Holdings Inc	123.478	0,36
311	Mercury General Corp	13.777	0,04
1.345	Meridian Bioscience Inc	40.915	0,12
1.299	Merit Medical Systems Inc	70.497	0,21
399	Meritage Homes Corp	28.928	0,09
1.216	Meritor Inc	44.177	0,13
62	Mesa Laboratories Inc	12.644	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
561	Methode Electronics Inc	20.779	0,06
1.884	MFA Financial Inc (REIT)	20.253	0,06
533	MGE Energy Inc	41.483	0,12
54	MicroStrategy Inc - Class A	8.872	0,03
269	Middlesex Water Co	23.586	0,07
1.463	MillerKnoll Inc	38.433	0,11
496	Minerals Technologies Inc	30.425	0,09
314	Model N Inc	8.032	0,02
142	ModivCare Inc	11.999	0,04
5.233	Moelis & Co - Class A	205.919	0,61
2.170	Momentive Global Inc	19.096	0,06
170	Monarch Casino & Resort Inc	9.974	0,03
409	Monro Inc	17.538	0,05
511	Montrose Environmental Group Inc	17.251	0,05
472	Moog Inc - Class A	37.472	0,11
510	Movado Group Inc	15.774	0,05
1.581	Mr Cooper Group Inc	58.086	0,17
2.127	MRC Global Inc	21.185	0,06
2.130	Mueller Industries Inc	113.508	0,33
2.605	Mueller Water Products Inc - Class A	30.557	0,09
5.698	Multiplan Corp	31.282	0,09
2.464	Murphy Oil Corp	74.388	0,22
440	Murphy USA Inc	102.463	0,30
893	Myers Industries Inc	20.298	0,06
382	MYR Group Inc	33.666	0,10
2.238	Myriad Genetics Inc	40.664	0,12
918	Napco Security Technologies Inc	18.902	0,06
347	National Bank Holdings Corp	13.280	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
959	National Beverage Corp	46.933	0,14
664	National Health Investors Inc (REIT)	40.245	0,12
359	National HealthCare Corp	25.094	0,07
117	National Presto Industries Inc	7.680	0,02
447	National Research Corp	17.111	0,05
1.334	National Vision Holdings Inc	36.685	0,11
838	Natus Medical Inc	27.461	0,08
1.255	Navient Corp	17.557	0,05
478	NBT Bancorp Inc	17.968	0,05
1.181	Necessity Retail REIT Inc/The (REIT)	8.598	0,03
3.565	Nektar Therapeutics - Class A	13.547	0,04
310	Nelnet Inc	26.428	0,08
3.060	Neogen Corp	73.715	0,22
2.177	NeoGenomics Inc	17.743	0,05
947	NETGEAR Inc	17.538	0,05
1.107	NetScout Systems Inc	37.472	0,11
510	NETSTREIT Corp (REIT)	9.624	0,03
584	Nevro Corp	25.597	0,08
1.600	New Jersey Resources Corp	71.248	0,21
4.229	New York Mortgage Trust Inc (REIT)	11.672	0,03
6.203	Newmark Group Inc	59.983	0,18
410	NexPoint Residential Trust Inc (REIT)	25.629	0,08
1.581	NextGen Healthcare Inc	27.573	0,08
2.333	NexTier Oilfield Solutions Inc	22.187	0,07
132	Nicolet Bankshares Inc	9.549	0,03
684	nLight Inc	6.990	0,02
2.255	NMI Holdings Inc - Class A	37.546	0,11
531	Northern Oil and Gas Inc	13.413	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
2.113	Northwest Bancshares Inc	27.046	0,08
482	Northwest Natural Holding Co	25.594	0,08
741	NorthWestern Corp	43.667	0,13
1.771	NOW Inc	17.320	0,05
983	Nu Skin Enterprises Inc - Class A	42.564	0,13
934	NuVasive Inc	45.915	0,14
225	NV5 Global Inc	26.267	0,08
2.677	Oceaneering International Inc	28.590	0,08
658	OceanFirst Financial Corp	12.588	0,04
795	ODP Corp/The	24.041	0,07
980	Office Properties Income Trust (REIT)	19.551	0,06
3.022	O-I Glass Inc	42.308	0,12
2.109	Old National Bancorp/IN	31.192	0,09
822	Omnicell Inc	93.502	0,28
774	ONE Gas Inc	62.841	0,19
535	OneSpan Inc	6.367	0,02
1.228	Onto Innovation Inc	85.641	0,25
8.974	Open Lending Corp	91.804	0,27
8.759	OPKO Health Inc	22.160	0,07
2.745	Option Care Health Inc	76.284	0,22
1.098	Organogenesis Holdings Inc - Class A	5.358	0,02
262	Origin Bancorp Inc	10.166	0,03
641	Ormat Technologies Inc	50.222	0,15
467	Orthofix Medical Inc	10.993	0,03
252	OSI Systems Inc	21.531	0,06
697	Otter Tail Corp	46.790	0,14
1.699	Outfront Media Inc (REIT)	28.798	0,08
744	Overstock.com Inc	18.607	0,05

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.649	Owens & Minor Inc	51.861	0,15
431	Oxford Industries Inc	38.247	0,11
1.837	Pacific Biosciences of California Inc	8.120	0,02
1.328	Pacific Premier Bancorp Inc	38.831	0,11
836	Pacira BioSciences Inc	48.739	0,14
1.024	PagerDuty Inc	25.375	0,07
280	Palomar Holdings Inc	18.032	0,05
598	Papa John's International Inc	49.945	0,15
2.275	Paramount Group Inc (REIT)	16.448	0,05
236	Park National Corp	28.615	0,08
373	Parsons Corp	15.077	0,04
392	Pathward Financial Inc	15.159	0,04
231	Patrick Industries Inc	11.975	0,04
821	Patterson Cos Inc	24.876	0,07
2.690	Patterson-UTI Energy Inc	42.394	0,13
7.138	Payoneer Global Inc	27.981	0,08
2.292	PBF Energy Inc - Class A	66.514	0,20
332	PC Connection Inc	14.625	0,04
847	PDF Solutions Inc	18.219	0,05
1.627	Peabody Energy Corp	34.704	0,10
992	Pebblebrook Hotel Trust (REIT)	16.437	0,05
1.089	Pediatric Medical Group Inc	22.880	0,07
481	PennyMac Financial Services Inc	21.025	0,06
1.262	PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT)	17.453	0,05
1.246	Perdoceo Education Corp	14.678	0,04
648	Perficient Inc	59.415	0,18
835	PGT Innovations Inc	13.894	0,04
1.419	Phillips Edison & Co Inc (REIT)	47.409	0,14

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.232	Photronics Inc	23.999	0,07
2.923	Physicians Realty Trust (REIT)	51.006	0,15
1.256	Piedmont Office Realty Trust Inc (REIT)	16.479	0,05
542	Ping Identity Holding Corp	9.832	0,03
552	Piper Sandler Cos	62.575	0,18
2.379	Pitney Bowes Inc	8.612	0,03
639	PJT Partners Inc	44.909	0,13
605	Plantronics Inc	24.006	0,07
544	Plexus Corp	42.704	0,13
1.350	PNM Resources Inc	64.503	0,19
2.502	Point Biopharma Global Inc	17.039	0,05
1.311	Portland General Electric Co	63.361	0,19
2.884	PotlatchDeltic Corp (REIT)	127.444	0,38
1.425	Power Integrations Inc	106.889	0,32
725	PRA Group Inc	26.361	0,08
182	Preferred Bank/Los Angeles CA	12.380	0,04
425	Premier Financial Corp	10.774	0,03
826	Prestige Consumer Healthcare Inc	48.569	0,14
424	PriceSmart Inc	30.371	0,09
526	Primoris Services Corp	11.446	0,03
552	ProAssurance Corp	13.044	0,04
899	PROG Holdings Inc	14.834	0,04
618	Progress Software Corp	27.995	0,08
2.570	Progyny Inc	74.658	0,22
2.232	ProPetro Holding Corp	22.320	0,07
398	PROS Holdings Inc	10.440	0,03
441	Proto Labs Inc	21.097	0,06
958	Provident Financial Services Inc	21.325	0,06

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.081	PS Business Parks Inc (REIT)	202.309	0,60
1.058	PTC Therapeutics Inc	42.383	0,13
1.005	PubMatic Inc	15.969	0,05
612	Q2 Holdings Inc	23.605	0,07
211	QCR Holdings Inc	11.392	0,03
179	Quaker Chemical Corp	26.764	0,08
935	Qualys Inc	117.941	0,35
505	Quanex Building Products Corp	11.489	0,03
234	Quanterix Corp	3.788	0,01
4.407	Qurate Retail Inc	12.648	0,04
2.504	R1 RCM Inc	52.484	0,15
3.540	Radian Group Inc	69.561	0,21
969	Radius Global Infrastructure Inc	14.787	0,04
858	RadNet Inc	14.826	0,04
2.768	Rambus Inc	59.484	0,18
781	Rapid7 Inc	52.171	0,15
201	RBC Bearings Inc	37.175	0,11
1.688	Ready Capital Corp (REIT)	20.121	0,06
496	Reata Pharmaceuticals Inc - Class A	15.073	0,04
1.116	Red Rock Resorts Inc	37.230	0,11
1.513	Redwood Trust Inc (REIT)	11.665	0,03
1.124	REGENXBIO Inc	27.763	0,08
751	Relay Therapeutics Inc	12.579	0,04
1.102	Renasant Corp	31.749	0,09
707	Rent-A-Center Inc/TX	13.751	0,04
937	Repay Holdings Corp - Class A	12.040	0,04
2.518	Resideo Technologies Inc	48.900	0,14
1.189	Resolute Forest Products Inc	15.172	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.803	Retail Opportunity Investments Corp (REIT)	28.451	0,08
1.082	REVOLUTION Medicines Inc	21.088	0,06
918	Revolve Group Inc	23.785	0,07
88	REX American Resources Corp	7.462	0,02
750	RLI Corp	87.442	0,26
1.426	RLJ Lodging Trust (REIT)	15.729	0,05
251	RMR Group Inc/The - Class A	7.116	0,02
320	Rogers Corp	83.869	0,25
991	RPT Realty (REIT)	9.742	0,03
759	Rush Enterprises Inc - Class A	36.584	0,11
1.255	Ruth's Hospitality Group Inc	20.406	0,06
488	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	37.103	0,11
452	S&T Bancorp Inc	12.398	0,04
2.124	Sabra Health Care REIT Inc (REIT)	29.672	0,09
3.683	Sabre Corp	21.472	0,06
264	Safehold Inc (REIT)	9.338	0,03
233	Safety Insurance Group Inc	22.624	0,07
463	Sage Therapeutics Inc	14.955	0,04
640	Saia Inc	120.320	0,35
1.098	Sailpoint Technologies Holdings Inc	68.823	0,20
989	Sally Beauty Holdings Inc	11.789	0,03
517	Sanderson Farms Inc	111.429	0,33
1.116	SandRidge Energy Inc	17.488	0,05
649	Sandy Spring Bancorp Inc	25.356	0,07
2.464	Sangamo Therapeutics Inc	10.201	0,03
782	Sanmina Corp	31.851	0,09
437	ScanSource Inc	13.608	0,04
540	Schnitzer Steel Industries Inc	17.734	0,05

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
300	Scholastic Corp	10.791	0,03
1.091	Schrodinger Inc/United States	28.813	0,09
788	Seacoast Banking Corp of Florida	26.036	0,08
1.043	SeaWorld Entertainment Inc	46.080	0,14
2.053	Select Medical Holdings Corp	48.492	0,14
1.045	Selective Insurance Group Inc	90.852	0,27
1.635	Semtech Corp	89.876	0,27
497	Sensient Technologies Corp	40.038	0,12
717	ServisFirst Bancshares Inc	56.586	0,17
510	Shake Shack Inc - Class A	20.135	0,06
771	Shoals Technologies Group Inc - Class A	12.706	0,04
1.353	Shockwave Medical Inc	258.653	0,76
286	Shoe Carnival Inc	6.180	0,02
453	Shutterstock Inc	25.961	0,08
1.005	Shyft Group Inc/The	18.683	0,06
1.196	SIGA Technologies Inc	13.850	0,04
571	Silicon Laboratories Inc	80.066	0,24
300	Silk Road Medical Inc	10.917	0,03
330	Silvergate Capital Corp - Class A	17.665	0,05
1.560	Simmons First National Corp - Class A	33.166	0,10
1.367	Simply Good Foods Co/The	51.632	0,15
1.013	Simpson Manufacturing Co Inc	101.918	0,30
369	Simulations Plus Inc	18.203	0,05
731	Sinclair Broadcast Group Inc - Class A	14.912	0,04
2.725	SITE Centers Corp (REIT)	36.706	0,11
233	SiTime Corp	37.986	0,11
374	SJW Group	23.341	0,07
1.609	Skyline Champion Corp	76.299	0,22

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
619	SkyWest Inc	13.154	0,04
626	Sleep Number Corp	19.375	0,06
2.184	SM Energy Co	74.671	0,22
2.865	Smith & Wesson Brands Inc	37.617	0,11
306	Sonic Automotive Inc - Class A	11.209	0,03
2.465	Sonos Inc	44.469	0,13
1.793	South Jersey Industries Inc	61.213	0,18
334	Southside Bancshares Inc	12.498	0,04
919	SouthState Corp	70.901	0,21
867	Southwest Gas Holdings Inc	75.498	0,22
843	SpartanNash Co	25.433	0,08
790	Spire Inc	58.752	0,17
1.269	Spirit Airlines Inc	30.253	0,09
999	Sprout Social Inc - Class A	58.012	0,17
1.668	Sprouts Farmers Market Inc	42.234	0,12
857	SPS Commerce Inc	96.884	0,29
670	SPX Corp	35.403	0,10
737	St Joe Co/The	29.156	0,09
1.306	STAAR Surgical Co	92.635	0,27
3.010	STAG Industrial Inc (REIT)	92.949	0,27
336	Standard Motor Products Inc	15.117	0,04
159	Standex International Corp	13.480	0,04
736	Steelcase Inc	7.897	0,02
2.250	Stem Inc	16.110	0,05
230	Stepan Co	23.311	0,07
1.216	StepStone Group Inc - Class A	31.652	0,09
2.335	Steven Madden Ltd	75.210	0,22
723	Stewart Information Services Corp	35.969	0,11

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
513	Stitch Fix Inc	2.534	0,01
384	Stock Yards Bancorp Inc	22.971	0,07
187	StoneX Group Inc	14.599	0,04
318	Strategic Education Inc	22.444	0,07
420	Stride Inc	17.132	0,05
370	Sturm Ruger & Co Inc	23.551	0,07
1.947	Summit Materials Inc - Class A	45.346	0,13
1.551	SunCoke Energy Inc	10.562	0,03
868	Sunnova Energy International Inc	15.997	0,05
968	SunPower Corp	15.304	0,05
3.140	Sunstone Hotel Investors Inc (REIT)	31.149	0,09
882	Super Micro Computer Inc	35.589	0,10
1.264	Supernus Pharmaceuticals Inc	36.555	0,11
609	Surgery Partners Inc	17.612	0,05
329	Summodics Inc	12.249	0,04
1.227	Sylvamo Corp	40.098	0,12
494	Synaptics Inc	58.317	0,17
1.898	Syndax Pharmaceuticals Inc	36.518	0,11
1.348	Talos Energy Inc	20.854	0,06
1.297	Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT)	18.443	0,05
1.867	Taylor Morrison Home Corp - Class A	43.613	0,13
555	TechTarget Inc	36.475	0,11
2.464	TEGNA Inc	51.670	0,15
1.738	Telephone and Data Systems Inc	27.443	0,08
2.250	Tellurian Inc	6.705	0,02
1.273	Tenable Holdings Inc	57.807	0,17
197	Tennant Co	11.672	0,03
793	Tenneco Inc	13.608	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.565	Terex Corp	42.834	0,13
1.135	Terreno Realty Corp (REIT)	63.254	0,19
719	Texas Capital Bancshares Inc	37.848	0,11
1.909	Texas Roadhouse Inc - Class A	139.739	0,41
1.338	TimkenSteel Corp	25.034	0,07
1.072	Titan International Inc	16.187	0,05
536	Titan Machinery Inc	12.012	0,04
166	Tompkins Financial Corp	11.969	0,04
310	Tootsie Roll Industries Inc	10.959	0,03
800	Towne Bank/Portsmouth VA	21.720	0,06
419	TravelCenters of America Inc	14.443	0,04
687	Traverse Therapeutics Inc	16.646	0,05
653	TreeHouse Foods Inc	27.308	0,08
1.752	Tri Pointe Homes Inc	29.556	0,09
657	TriCo Bancshares	29.985	0,09
689	TriMas Corp	19.078	0,06
664	TriNet Group Inc	51.540	0,15
950	Trinity Industries Inc	23.009	0,07
436	Triumph Bancorp Inc	27.276	0,08
465	TrueBlue Inc	8.324	0,02
405	Trupanion Inc	24.405	0,07
960	Trustmark Corp	28.022	0,08
337	TTEC Holdings Inc	22.879	0,07
2.237	TTM Technologies Inc	27.963	0,08
996	Turning Point Therapeutics Inc	74.949	0,22
5.344	Two Harbors Investment Corp (REIT)	26.613	0,08
1.900	UFP Industries Inc	129.466	0,38
691	Ultra Clean Holdings Inc	20.571	0,06

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
597	UMB Financial Corp	51.402	0,15
505	UMH Properties Inc (REIT)	8.918	0,03
284	UniFirst Corp/MA	48.899	0,14
1.787	United Bankshares Inc/WV	62.670	0,18
1.231	United Community Banks Inc/GA	37.164	0,11
781	United Natural Foods Inc	30.771	0,09
3.693	Uniti Group Inc (REIT)	34.788	0,10
222	Unitil Corp	13.036	0,04
322	Universal Corp/VA	19.481	0,06
711	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	37.832	0,11
359	Univest Financial Corp	9.133	0,03
1.372	Upwork Inc	28.373	0,08
2.034	Urban Edge Properties (REIT)	30.937	0,09
1.612	Urban Outfitters Inc	30.080	0,09
309	US Physical Therapy Inc	33.743	0,10
387	USANA Health Sciences Inc	28.003	0,08
89	Utah Medical Products Inc	7.645	0,02
599	Utz Brands Inc	8.278	0,02
2.476	VAALCO Energy Inc	17.183	0,05
5.411	Valley National Bancorp	56.329	0,17
1.686	Vanda Pharmaceuticals Inc	18.377	0,05
604	Varex Imaging Corp	12.920	0,04
1.015	Varonis Systems Inc - Class B	29.760	0,09
660	Vaxcyte Inc	14.362	0,04
2.390	Vector Group Ltd	25.095	0,07
561	Veeco Instruments Inc	10.883	0,03
1.067	Vericel Corp	26.867	0,08
941	Verint Systems Inc	39.851	0,12

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
993	Veris Residential Inc (REIT)	13.147	0,04
584	Veritex Holdings Inc	17.088	0,05
158	Veritiv Corp	17.151	0,05
1.602	Verra Mobility Corp - Class A	25.167	0,07
4.006	Viavi Solutions Inc	52.999	0,16
597	Vicor Corp	32.674	0,10
589	Victory Capital Holdings Inc - Class A	14.195	0,04
2.453	Vimeo Inc	14.767	0,04
3.196	Vir Biotechnology Inc	81.402	0,24
101	Virtus Investment Partners Inc	17.273	0,05
3.404	Vishay Intertechnology Inc	60.659	0,18
883	Vista Outdoor Inc	24.636	0,07
344	Visteon Corp	35.632	0,11
4.524	Vonage Holdings Corp	85.232	0,25
578	Walker & Dunlop Inc	55.685	0,16
1.139	Warby Parker Inc	12.825	0,04
1.125	Warrior Met Coal Inc	34.436	0,10
1.242	Washington Federal Inc	37.285	0,11
961	Washington Real Estate Investment Trust (REIT)	20.479	0,06
194	Washington Trust Bancorp Inc	9.384	0,03
669	Watts Water Technologies Inc - Class A	82.180	0,24
261	WD-40 Co	52.555	0,15
437	Weis Markets Inc	32.574	0,10
1.646	Welbilt Inc	39.191	0,12
1.307	Werner Enterprises Inc	50.372	0,15
1.106	WesBanco Inc	35.071	0,10
292	Westamerica BanCorp	16.253	0,05
6.233	Wheels Up Experience Inc	12.154	0,04

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,70 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,22 %) (Fortsetzung)</b>			
1.060	Whiting Petroleum Corp	72.112	0,21
747	WideOpenWest Inc	13.603	0,04
423	Wingstop Inc	31.628	0,09
242	Winmark Corp	47.328	0,14
773	Winnebago Industries Inc	37.537	0,11
2.783	WisdomTree Investments Inc	14.110	0,04
6.013	WM Technology Inc	19.783	0,06
1.149	Wolverine World Wide Inc	23.164	0,07
512	Workiva Inc - Class A	33.787	0,10
99	World Acceptance Corp	11.112	0,03
1.813	World Fuel Services Corp	37.094	0,11
441	Worthington Industries Inc	19.448	0,06
910	WSFS Financial Corp	36.482	0,11
1.694	Xencor Inc	46.365	0,14
938	Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT)	13.629	0,04
1.637	Xerox Holdings Corp	24.309	0,07
201	XPEL Inc	9.232	0,03
1.222	Xperi Holding Corp	17.633	0,05
1.347	Yelp Inc - Class A	37.406	0,11
1.578	Yext Inc	7.543	0,02
324	York Water Co/The	13.099	0,04
253	Zentalis Pharmaceuticals Inc	7.109	0,02
685	Ziff Davis Inc	51.053	0,15
1.060	ZipRecruiter Inc	15.709	0,05
345	Zumiez Inc	8.970	0,03
1.760	Zuora Inc	15.752	0,05
3.978	Zurn Elkay Water Solutions Corp	108.361	0,32
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>32.085.779</b>	<b>94,59</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>33.728.032</b>	<b>99,43</b>

## L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Gesamtanlagen		
Stammaktien	33.728.032	99,43
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	193.167	0,57
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>33.921.199</b>	<b>100,00</b>
Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,41
Sonstige Vermögenswerte		0,59
		<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

## L&amp;G Gold Mining UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,82 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 14,64 %)</b>			
1.360.828	Evolution Mining Ltd	2.227.188	1,75
584.454	Newcrest Mining Ltd	8.395.865	6,60
1.310.571	Northern Star Resources Ltd	6.164.435	4,84
1.513.323	Ramelius Resources Ltd	905.373	0,71
1.420.657	Regis Resources Ltd	1.270.016	1,00
1.141.420	Silver Lake Resources Ltd	949.746	0,75
2.035.699	St Barbara Ltd	1.049.909	0,82
1.291.913	Westgold Resources Ltd	1.052.757	0,83
	<b>Australien insgesamt</b>	<b>22.015.289</b>	<b>17,30</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 46,14 %)</b>			
195.227	Agnico Eagle Mines Ltd (Units)	8.917.110	7,01
310.884	Alamos Gold Inc - Class A	2.176.244	1,71
1.334.121	Argonaut Gold Inc	465.403	0,37
1.032.990	Barrick Gold Corp	18.225.938	14,33
1.074.700	Calibre Mining Corp	808.129	0,64
190.835	Centerra Gold Inc	1.291.498	1,01
262.897	Dundee Precious Metals Inc (Units)	1.306.367	1,03
531.799	Equinox Gold Corp	2.366.361	1,86
122.800	First Majestic Silver Corp	878.662	0,69
360.400	Fortuna Silver Mines Inc	1.022.557	0,80
1.389.823	IAMGOLD Corp	2.230.239	1,75
120.000	K92 Mining Inc	722.809	0,57
2.417.749	Kinross Gold Corp	8.584.168	6,75
277.040	Lundin Gold Inc	1.984.431	1,56
1.165.457	New Gold Inc	1.237.765	0,97
238.390	Torex Gold Resources Inc	1.836.944	1,44
76.400	Victoria Gold Corp	591.671	0,46

## L&G Gold Mining UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Kanada (30. Juni 2021: 46,14 %) (Fortsetzung)</b>			
88.100	Wesdome Gold Mines Ltd	761.504	0,60
857.648	Yamana Gold Inc (Units)	3.982.515	3,13
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>59.390.315</b>	<b>46,68</b>
<b>Südafrika (30. Juni 2021: 14,98 %)</b>			
709.104	AngloGold Ashanti Ltd	10.605.924	8,34
1.008.437	Gold Fields Ltd	9.418.018	7,40
<b>Südafrika insgesamt</b>		<b>20.023.942</b>	<b>15,74</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 2,21 %)</b>			
413.551	Fresnillo Plc	3.851.153	3,03
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>3.851.153</b>	<b>3,03</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 17,37 %)</b>			
533.074	Coeur Mining Inc	1.620.545	1,28
332.857	Newmont Corp	19.861.577	15,61
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>21.482.122</b>	<b>16,89</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>126.762.821</b>	<b>99,64</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		126.762.821	99,64
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		453.608	0,36
		<b>127.216.429</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,58
Sonstige Vermögenswerte			0,42
			<b>100,00</b>
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 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2021: 90,69 %)</b>					
29.294.923	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	22.07.2022	29.294.923	94,96
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>29.294.923</b>	<b>94,96</b>

Nominal	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2021: (2,09 %))</b>			
31.740.860	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR <sup>1</sup>	(869.132)	(2,82)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten</b>			<b>(869.132)</b>

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2021: 7,26 %)</b>			
2.341.426	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund	2.341.426	7,59
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>2.341.426</b>

<b>Gesamtanlagen</b>			
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	29.294.923	94,96
	Geldmarktinstrumente	2.341.426	7,59
	Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten	(869.132)	(2,82)
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	82.593	0,27
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>30.849.810</b>	<b>100,00</b>

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden			7,38
Einlagen bei Kreditinstituten			92,30
Sonstige Vermögenswerte			0,32
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %)</b>			
<b>Belgien (30. Juni 2021: 1,18 %)</b>			
885.849	Materialise NV ADR	12.065.263	1,50
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>12.065.263</b>	<b>1,50</b>
<b>Bermuda (30. Juni 2021: – %)</b>			
4.784.155	AutoStore Holdings Ltd '144A'	6.779.374	0,85
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>6.779.374</b>	<b>0,85</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 2,78 %)</b>			
422.778	ATS Automation Tooling Systems Inc	11.585.728	1,45
106.476	Novanta Inc	12.912.344	1,61
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>24.498.072</b>	<b>3,06</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 2,84 %)</b>			
418.637	Airtac International Group	13.952.924	1,74
133.949	Ambarella Inc	8.768.301	1,09
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>22.721.225</b>	<b>2,83</b>
<b>China (30. Juni 2021: 1,79 %)</b>			
765.048	Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A'	3.780.605	0,47
618.481	Iflytek Co Ltd 'A'	3.802.643	0,48
253.352	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd 'A'	2.489.220	0,31
1.659.337	Siasun Robot & Automation Co Ltd 'A'	2.494.861	0,31
<b>China insgesamt</b>		<b>12.567.329</b>	<b>1,57</b>
<b>Finnland (30. Juni 2021: 0,96 %)</b>			
278.257	Cargotec Oyj - Class B	7.295.885	0,91
<b>Finnland insgesamt</b>		<b>7.295.885</b>	<b>0,91</b>

## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 2,10 %)</b>			
263.262	Dassault Systemes SE	9.664.629	1,20
60.963	Schneider Electric SE	7.195.560	0,90
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>16.860.189</b>	<b>2,10</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 6,21 %)</b>			
375.690	Duerr AG	8.625.143	1,07
326.084	GEA Group AG	11.212.377	1,40
374.539	Jenoptik AG	8.332.456	1,04
164.097	KION Group AG	6.791.888	0,85
130.493	Krones AG	9.931.685	1,24
69.863	Siemens AG	7.091.303	0,88
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>51.984.852</b>	<b>6,48</b>
<b>Israel (30. Juni 2021: 1,57 %)</b>			
676.118	Stratasys Ltd	12.670.451	1,58
<b>Israel insgesamt</b>		<b>12.670.451</b>	<b>1,58</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 19,10 %)</b>			
436.115	Amano Corp	7.527.803	0,94
220.563	Daifuku Co Ltd	12.598.498	1,57
236.648	Daihen Corp	7.298.628	0,91
91.210	FANUC Corp	14.260.060	1,78
767.546	Fuji Corp/Aichi	11.299.489	1,41
589.269	Harmonic Drive Systems Inc	17.154.753	2,14
36.798	Keyence Corp	12.562.595	1,57
711.777	Mitsubishi Electric Corp	7.602.138	0,95
429.239	Nabtesco Corp	10.015.735	1,25
211.648	Omron Corp	10.735.464	1,34

## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 19,10 %) (Fortsetzung)</b>			
517.508	Optex Group Co Ltd	7.694.720	0,96
307.815	Shibaura Machine Co Ltd	5.983.876	0,75
23.721	SMC Corp	10.558.381	1,32
523.275	THK Co Ltd	9.810.323	1,22
177.162	Toyota Industries Corp	10.954.038	1,36
367.256	Yaskawa Electric Corp	11.813.395	1,47
671.949	Yokogawa Electric Corp	11.084.154	1,38
<b>Japan insgesamt</b>		<b>178.954.050</b>	<b>22,32</b>
<b>Jersey (30. Juni 2021: 0,93 %)</b>			
85.170	Aptiv Plc	7.586.092	0,95
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>7.586.092</b>	<b>0,95</b>
<b>Südkorea (30. Juni 2021: 1,52 %)</b>			
830.497	Koh Young Technology Inc	9.018.798	1,12
<b>Südkorea insgesamt</b>		<b>9.018.798</b>	<b>1,12</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 2,23 %)</b>			
1.028.000	Elekta AB	7.088.482	0,88
1.127.937	Hexagon AB	11.695.001	1,46
<b>Schweden insgesamt</b>		<b>18.783.483</b>	<b>2,34</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 4,12 %)</b>			
367.918	ABB Ltd	9.784.532	1,22
85.194	Kardex Holding AG	14.113.764	1,76
38.956	Tecan Group AG	11.279.718	1,41
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>35.178.014</b>	<b>4,39</b>

## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Taiwan (30. Juni 2021: 4,53 %)</b>			
903.675	Advantech Co Ltd	10.515.800	1,31
1.134.262	Delta Electronics Inc	8.449.696	1,05
429.829	Global Unichip Corp	6.953.361	0,87
1.529.759	Hiwin Technologies Corp	12.270.587	1,53
	<b>Taiwan insgesamt</b>	<b>38.189.444</b>	<b>4,76</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 3,48 %)</b>			
963.103	Ocado Group Plc	9.137.231	1,14
234.981	Renishaw Plc	10.182.097	1,27
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>19.319.328</b>	<b>2,41</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 43,39 %)</b>			
1.058.222	3D Systems Corp	10.264.753	1,28
1.121.813	AppHarvest Inc	3.915.127	0,49
46.490	Autodesk Inc	7.994.420	1,00
203.358	Azenta Inc	14.662.112	1,83
72.111	Cadence Design Systems Inc	10.818.813	1,35
310.608	Cognex Corp	13.207.052	1,65
30.353	Deere & Co	9.089.813	1,13
295.520	FARO Technologies Inc	9.110.882	1,14
131.235	Globus Medical Inc	7.367.533	0,92
160.470	GXO Logistics Inc	6.943.537	0,87
61.348	Illumina Inc	11.310.117	1,41
72.915	Intuitive Surgical Inc	14.634.770	1,82
146.782	IPG Photonics Corp	13.816.590	1,72
92.432	iRhythm Technologies Inc	9.985.429	1,25
352.394	iRobot Corp	12.950.480	1,61
77.258	John Bean Technologies Corp	8.530.828	1,06

## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 43,39 %) (Fortsetzung)</b>			
1.105.311	Luminar Technologies Inc - Class A	6.554.494	0,82
91.725	Manhattan Associates Inc	10.511.685	1,31
129.291	Microchip Technology Inc	7.509.221	0,94
338.271	National Instruments Corp	10.564.203	1,32
58.008	Nordson Corp	11.743.140	1,46
62.352	NVIDIA Corp	9.451.940	1,18
117.060	Omniceil Inc	13.315.575	1,66
99.119	PTC Inc	10.540.315	1,31
75.343	QUALCOMM Inc	9.624.315	1,20
66.572	Rockwell Automation Inc	13.268.465	1,65
914.344	Samsara Inc	10.213.223	1,27
29.343	ServiceNow Inc	13.953.183	1,74
127.868	Teradyne Inc	11.450.579	1,43
150.407	Trimble Inc	8.758.200	1,09
702.731	Vicarious Surgical Inc	2.066.029	0,26
44.116	Zebra Technologies Corp	12.967.898	1,62
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>327.094.721</b>	<b>40,79</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>801.566.570</b>	<b>99,96</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	801.566.570	99,96
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	305.313	0,04
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>801.871.883</b>	<b>100,00</b>

**L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2022

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,89
Sonstige Vermögenswerte	0,11
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

## L&amp;G Cyber Security UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,86 %)</b>			
<b>Kanada (30. Juni 2021: 4,92 %)</b>			
2.722.307	Absolute Software Corp	23.425.108	0,95
17.251.435	BlackBerry Ltd	92.812.445	3,75
	<b>Kanada insgesamt</b>	<b>116.237.553</b>	<b>4,70</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 1,74 %)</b>			
1.118.009	Atos SE	14.943.433	0,61
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>14.943.433</b>	<b>0,61</b>
<b>Israel (30. Juni 2021: 9,13 %)</b>			
926.038	Check Point Software Technologies Ltd	112.772.908	4,56
4.194.898	Cognyte Software Ltd	17.828.316	0,72
758.720	CyberArk Software Ltd	97.085.811	3,93
2.698.697	Radware Ltd	58.480.764	2,37
	<b>Israel insgesamt</b>	<b>286.167.799</b>	<b>11,58</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 4,37 %)</b>			
673.102	Digital Arts Inc	28.984.188	1,17
2.170.321	Trend Micro Inc/Japan	105.756.324	4,28
	<b>Japan insgesamt</b>	<b>134.740.512</b>	<b>5,45</b>
<b>Südkorea (30. Juni 2021: 1,12 %)</b>			
490.738	Ahnlab Inc	32.655.392	1,32
	<b>Südkorea insgesamt</b>	<b>32.655.392</b>	<b>1,32</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 2,70 %)</b>			
16.929.790	Fingerprint Cards AB - Class B	14.776.441	0,60
	<b>Schweden insgesamt</b>	<b>14.776.441</b>	<b>0,60</b>

## L&amp;G Cyber Security UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 5,70 %)</b>			
21.609.389	Darktrace Plc	77.313.417	3,13
12.816.183	NCC Group Plc	29.136.956	1,18
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>106.450.373</b>	<b>4,31</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 68,90 %)</b>			
2.208.796	A10 Networks Inc	31.762.486	1,29
1.072.401	Akamai Technologies Inc	97.942.383	3,96
350.782	Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A	31.696.662	1,28
2.296.162	Cisco Systems Inc	97.908.348	3,96
1.069.624	Cloudflare Inc	46.796.050	1,89
563.827	CrowdStrike Holdings Inc	95.038.679	3,85
147.465	F5 Inc	22.568.044	0,91
7.366.741	Fastly Inc	85.527.863	3,46
1.873.266	Fortinet Inc	105.989.390	4,29
3.445.479	Juniper Networks Inc	98.196.152	3,97
2.874.070	Mitek Systems Inc	26.556.407	1,08
3.991.084	NetScout Systems Inc	135.098.193	5,47
4.827.828	NortonLifeLock Inc	106.019.103	4,29
204.112	Okta Inc	18.451.725	0,75
2.125.963	OneSpan Inc	25.298.960	1,02
205.674	Palo Alto Networks Inc	101.590.616	4,11
796.194	Parsons Corp	32.182.161	1,30
4.573.145	Ping Identity Holding Corp	82.956.850	3,36
899.052	Qualys Inc	113.406.419	4,59
2.760.995	Rackspace Technology Inc	19.796.334	0,80
276.994	Rapid7 Inc	18.503.199	0,75
602.047	Sailpoint Technologies Holdings Inc	37.736.306	1,53
2.315.003	SolarWinds Corp	23.728.781	0,96

## L&G Cyber Security UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 68,90 %) (Fortsetzung)</b>			
861.543	Splunk Inc	76.212.094	3,08
2.640.335	Sumo Logic Inc	19.776.109	0,80
2.529.562	Telos Corp	20.438.861	0,83
533.184	Tenable Holdings Inc	24.211.885	0,98
648.143	Varonis Systems Inc - Class B	19.003.553	0,77
1.124.387	VMware Inc	128.157.630	5,19
127.705	Zscaler Inc	19.093.175	0,77
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>1.761.644.418</b>	<b>71,29</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>2.467.615.921</b>	<b>99,86</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	2.467.615.921	99,86
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	3.458.401	0,14
		<b>2.471.074.322</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,80
	Sonstige Vermögenswerte		0,20
			<b>100,00</b>
	Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

## L&amp;G All Commodities UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2021: 89,35 %)</b>					
102.009.070	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	102.009.070	96,15
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>102.009.070</b>	<b>96,15</b>

Nominal	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens	
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2021: 3,16 %)</b>				
113.058.208	Bloomberg Commodity Index Total Return <sup>1</sup>	21.07.2022	(6.923.757)	(6,53)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten</b>			<b>(6.923.757)</b>	<b>(6,53)</b>

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens	
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2021: 9,10 %)</b>				
7.316.215	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund	7.316.215	6,90	
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>			<b>7.316.215</b>	<b>6,90</b>

<b>Gesamtanlagen</b>					
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				102.009.070	96,15
Geldmarktinstrumente				7.316.215	6,90
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten				(6.923.757)	(6,53)
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				3.694.930	3,48
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>106.096.458</b>	<b>100,00</b>

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden			6,47
Einlagen bei Kreditinstituten			90,19
Sonstige Vermögenswerte			3,34
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

## L&amp;G Battery Value-Chain UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 9,15 %)</b>			
3.880.737	Allkem Ltd	27.513.733	3,55
829.718	Mineral Resources Ltd	27.541.301	3,56
17.129.262	Pilbara Minerals Ltd	26.974.337	3,49
	<b>Australien insgesamt</b>	<b>82.029.371</b>	<b>10,60</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: – %)</b>			
342.442	Largo Inc	2.333.444	0,30
	<b>Kanada insgesamt</b>	<b>2.333.444</b>	<b>0,30</b>
<b>China (30. Juni 2021: 4,68 %)</b>			
1.140.264	BYD Co Ltd 'H'	45.628.185	5,89
	<b>China insgesamt</b>	<b>45.628.185</b>	<b>5,89</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 5,87 %)</b>			
2.667.804	Bolloré SE	12.327.657	1,59
1.354.305	Renault SA	33.683.349	4,35
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>46.011.006</b>	<b>5,94</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 5,97 %)</b>			
396.905	Bayerische Motoren Werke AG	30.481.886	3,94
505.465	Mercedes-Benz Group AG	29.180.440	3,77
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>59.662.326</b>	<b>7,71</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 22,25 %)</b>			
815.735	GS Yuasa Corp	12.747.455	1,64
2.411.251	NGK Insulators Ltd	32.444.643	4,19
8.277.175	Nissan Motor Co Ltd	32.181.399	4,16

## L&amp;G Battery Value-Chain UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 22,25 % (Fortsetzung))</b>			
3.710.912	Panasonic Holdings Corp	29.951.162	3,87
2.955.001	Sumitomo Electric Industries Ltd	32.604.958	4,21
1.051.022	TDK Corp	32.415.313	4,19
	<b>Japan insgesamt</b>	<b>172.344.930</b>	<b>22,26</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 2,63 %)</b>			
981.829	AMG Advanced Metallurgical Group NV	25.250.809	3,26
	<b>Niederlande insgesamt</b>	<b>25.250.809</b>	<b>3,26</b>
<b>Südkorea (30. Juni 2021: 11,83 %)</b>			
278.028	Hyundai Electric & Energy System Co Ltd	5.428.227	0,70
105.271	LG Energy Solution Ltd	30.079.744	3,88
68.504	Samsung SDI Co Ltd	28.068.489	3,63
113.859	Sebang Global Battery Co Ltd	4.621.356	0,60
	<b>Südkorea insgesamt</b>	<b>68.197.816</b>	<b>8,81</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 2,93 %)</b>			
1.140.874	ABB Ltd	30.340.779	3,92
	<b>Schweiz insgesamt</b>	<b>30.340.779</b>	<b>3,92</b>
<b>Taiwan (30. Juni 2021: 3,02 %)</b>			
4.212.460	Delta Electronics Inc	31.380.761	4,05
21.855.800	Taiwan Cement Corp	29.034.728	3,75
	<b>Taiwan insgesamt</b>	<b>60.415.489</b>	<b>7,80</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 26,03 %)</b>			
511.059	EnerSys	30.132.039	3,89
1.970.281	ESS Tech Inc	5.536.490	0,72

## L&amp;G Battery Value-Chain UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 26,03 %) (Fortsetzung)</b>			
424.500	General Electric Co	27.027.915	3,49
1.185.177	Livent Corp	26.891.666	3,47
131.880	SolarEdge Technologies Inc	36.092.918	4,66
38.362	Tesla Inc	25.833.738	3,34
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>151.514.766</b>	<b>19,57</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>743.728.921</b>	<b>96,06</b>
<b>Vorzugsaktien (3. Juni 2021: – %)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: – %)</b>			
215.132	Volkswagen AG - Preference	28.658.071	3,70
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>28.658.071</b>	<b>3,70</b>
	<b>Vorzugsaktien Insgesamt</b>	<b>28.658.071</b>	<b>3,70</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	743.728.921	96,06
	Vorzugsaktien	28.658.071	3,70
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.843.780	0,24
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>774.230.772</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,38
	Sonstige Vermögenswerte		0,62
			<b>100,00</b>
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 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021 99,82 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 3,09 %)</b>			
47.756	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	487.676	1,44
5.668	CSL Ltd	1.048.710	3,09
<b>Australien insgesamt</b>		<b>1.536.386</b>	<b>4,53</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 5,67 %)</b>			
1.820.003	Sino Biopharmaceutical Ltd	1.152.727	3,40
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>1.152.727</b>	<b>3,40</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 3,70 %)</b>			
3.442	Genmab A/S	1.111.471	3,27
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>1.111.471</b>	<b>3,27</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 6,56 %)</b>			
9.892	Ipsen SA	931.263	2,74
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>931.263</b>	<b>2,74</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 5,88 %)</b>			
457.926	Endo International Plc	213.256	0,63
10.828	Horizon Therapeutics Plc	863.641	2,54
6.968	Jazz Pharmaceuticals Plc	1.087.078	3,20
<b>Irland insgesamt</b>		<b>2.163.975</b>	<b>6,37</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 13,22 %)</b>			
33.530	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	856.421	2,52
44.685	Kyowa Kirin Co Ltd	1.003.196	2,95
16.200	Nippon Shinyaku Co Ltd	983.770	2,90
<b>Japan insgesamt</b>		<b>2.843.387</b>	<b>8,37</b>

## L&amp;G Pharma Breakthrough UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien (30. Juni 2021: 5,19 %)</b>			
61.924	Grifols SA	1.167.561	3,44
17.951	Pharma Mar SA	1.263.013	3,72
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>2.430.574</b>	<b>7,16</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 3,09 %)</b>			
57.900	Swedish Orphan Biovitrum AB	1.249.828	3,68
<b>Schweden insgesamt</b>		<b>1.249.828</b>	<b>3,68</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 6,29 %)</b>			
12.699	Novartis AG ADR	1.073.446	3,16
2.952	Roche Holding AG	982.256	2,89
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>2.055.702</b>	<b>6,05</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 2,41 %)</b>			
53.776	Amryt Pharma Plc ADR	375.894	1,11
83.281	Oxford Biomedica Plc	459.179	1,35
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>835.073</b>	<b>2,46</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 44,72 %)</b>			
7.148	AbbVie Inc	1.094.788	3,22
6.544	Alnylam Pharmaceuticals Inc	954.443	2,81
5.138	Biogen Inc	1.047.844	3,09
14.100	BioMarin Pharmaceutical Inc	1.168.467	3,44
15.515	Bristol-Myers Squibb Co	1.194.655	3,52
25.875	Emergent BioSolutions Inc	803.160	2,37
30.650	Halozyme Therapeutics Inc	1.348.600	3,97
15.362	Incyte Corp	1.167.051	3,44
33.317	Ionis Pharmaceuticals Inc	1.233.395	3,63

## L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 44,72 %) (Fortsetzung)</b>			
6.349	Johnson & Johnson	1.127.011	3,32
102.488	Nektar Therapeutics - Class A	389.454	1,15
32.287	PTC Therapeutics Inc	1.293.417	3,81
13.560	Sarepta Therapeutics Inc	1.016.458	2,99
17.141	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	1.022.632	3,01
6.166	United Therapeutics Corp	1.452.956	4,28
4.509	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.270.591	3,74
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>17.584.922</b>	<b>51,79</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>33.895.308</b>	<b>99,82</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		33.895.308	99,82
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		62.184	0,18
		<b>33.957.492</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,78
Sonstige Vermögenswerte			0,22
			<b>100,00</b>
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 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,68 %)</b>			
<b>Belgien (30. Juni 2021: 2,70 %)</b>			
1.162.612	bpost SA	6.849.093	2,59
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>6.849.093</b>	<b>2,59</b>
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 2,17 %)</b>			
2.742.115	Kerry Logistics Network Ltd	5.898.699	2,23
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>5.898.699</b>	<b>2,23</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 5,24 %)</b>			
105.263	Descartes Systems Group Inc/The	6.527.290	2,47
111.690	Shopify Inc - Class A	3.482.394	1,31
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>10.009.684</b>	<b>3,78</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 5,72 %)</b>			
69.636	Alibaba Group Holding Ltd ADR	7.916.221	2,99
3.191.015	JD Logistics Inc '144A'	6.961.947	2,63
820.725	Vipshop Holdings Ltd ADR	8.116.970	3,07
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>22.995.138</b>	<b>8,69</b>
<b>China (30. Juni 2021: 2,30 %)</b>			
10.199.547	Sinotrans Ltd 'H'	2.924.567	1,11
<b>China insgesamt</b>		<b>2.924.567</b>	<b>1,11</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 5,29 %)</b>			
2.532	AP Moller - Maersk A/S - Class B	5.892.765	2,23
39.731	DSV A/S	5.536.267	2,09
104.282	NTG Nordic Transport Group A/S	3.701.663	1,40
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>15.130.695</b>	<b>5,72</b>

## L&amp;G Ecommerce Logistics UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,68 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 2,43 %)</b>			
1.431.789	Bollore SE	6.616.154	2,50
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>6.616.154</b>	<b>2,50</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 7,80 %)</b>			
164.133	Deutsche Post AG	6.132.743	2,32
69.930	SAP SE	6.355.322	2,40
147.292	Zalando SE '144A'	3.843.511	1,45
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>16.331.576</b>	<b>6,17</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 16,57 %)</b>			
140.683	Hitachi Transport System Ltd	8.864.205	3,35
1.031.954	Japan Post Holdings Co Ltd	7.361.280	2,78
298.694	Kintetsu World Express Inc	9.168.260	3,47
114.819	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	6.228.818	2,35
94.406	Nippon Yusen KK	6.441.748	2,44
985.436	Rakuten Group Inc	4.439.195	1,68
1.041.714	Senko Group Holdings Co Ltd	6.732.361	2,54
<b>Japan insgesamt</b>		<b>49.235.867</b>	<b>18,61</b>
<b>Neuseeland (30. Juni 2021: 2,00 %)</b>			
133.895	Mainfreight Ltd	5.819.052	2,20
<b>Neuseeland insgesamt</b>		<b>5.819.052</b>	<b>2,20</b>
<b>Südkorea (30. Juni 2021: 2,13 %)</b>			
73.959	CJ Logistics Corp	6.493.627	2,45
<b>Südkorea insgesamt</b>		<b>6.493.627</b>	<b>2,45</b>

## L&amp;G Ecommerce Logistics UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,68 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien (30. Juni 2021: 2,24 %)</b>			
421.491	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	8.222.508	3,11
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>8.222.508</b>	<b>3,11</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 2,58 %)</b>			
27.213	Kuehne + Nagel International AG	6.424.147	2,43
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>6.424.147</b>	<b>2,43</b>
<b>Taiwan (30. Juni 2021: 3,72 %)</b>			
2.093.290	Dimerco Express Corp	4.935.162	1,86
<b>Taiwan insgesamt</b>		<b>4.935.162</b>	<b>1,86</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 6,00 %)</b>			
497.543	Ocado Group Plc	4.720.331	1,78
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>4.720.331</b>	<b>1,78</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 30,79 %)</b>			
46.883	Amazon.com Inc	4.979.443	1,88
46.820	Concentrix Corp	6.350.665	2,40
132.972	eBay Inc	5.540.943	2,09
76.722	Expeditors International of Washington Inc	7.477.326	2,83
34.684	FedEx Corp	7.863.210	2,97
134.825	GXO Logistics Inc	5.833.878	2,21
54.765	Manhattan Associates Inc	6.276.069	2,37
93.570	Oracle Corp	6.537.736	2,47
46.283	Prologis Inc (REIT)	5.445.195	2,06
103.704	Ryder System Inc	7.369.206	2,79
56.877	SPS Commerce Inc	6.429.945	2,43

## L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,68 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 30,79 %) (Fortsetzung)</b>			
74.693	TD SYNEX Corp	6.804.532	2,57
37.138	United Parcel Service Inc - Class B	6.779.171	2,56
50.817	Walmart Inc	6.178.331	2,34
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>89.865.650</b>	<b>33,97</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>262.471.950</b>	<b>99,20</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		262.471.950	99,20
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		2.103.394	0,80
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>264.575.344</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,16
Sonstige Vermögenswerte			0,84
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %)</b>			
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 0,18 %)</b>			
4.336	Arch Capital Group Ltd	197.245	0,05
515	Everest Re Group Ltd	144.344	0,04
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>341.589</b>	<b>0,09</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,05 %)</b>			
756	GLOBALFOUNDRIES Inc	30.497	0,01
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>30.497</b>	<b>0,01</b>
<b>Curaçao (30. Juni 2021: 0,13 %)</b>			
16.833	Schlumberger NV	601.948	0,16
<b>Curacao insgesamt</b>		<b>601.948</b>	<b>0,16</b>
<b>Guernsey (30. Juni 2021: 0,03 %)</b>			
1.361	Amdocs Ltd	113.385	0,03
<b>Guernsey insgesamt</b>		<b>113.385</b>	<b>0,03</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 2,07 %)</b>			
7.969	Accenture Plc - Class A	2.212.593	0,57
2.426	Aon Plc	654.244	0,17
4.710	Eaton Corp Plc	593.413	0,15
2.657	Horizon Therapeutics Plc	211.922	0,06
677	Jazz Pharmaceuticals Plc	105.619	0,03
8.446	Johnson Controls International plc	404.394	0,10
6.040	Linde Plc	1.736.681	0,45
16.178	Medtronic Plc	1.451.976	0,38
2.493	Seagate Technology Holdings Plc	178.100	0,05
1.192	STERIS Plc	245.731	0,06
2.793	Trane Technologies Plc	362.727	0,09
1.306	Willis Towers Watson Plc	257.791	0,07
<b>Irland insgesamt</b>		<b>8.415.191</b>	<b>2,18</b>

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Jersey (30. Juni 2021: 0,16 %)</b>			
18.439	Amcor Plc	229.197	0,06
3.147	Aptiv Plc	280.303	0,07
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>509.500</b>	<b>0,13</b>
<b>Liberia (30. Juni 2021: 0,05 %)</b>			
2.521	Royal Caribbean Cruises Ltd	88.008	0,02
<b>Liberia insgesamt</b>		<b>88.008</b>	<b>0,02</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 0,09 %)</b>			
1.381	Spotify Technology SA	129.579	0,03
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>129.579</b>	<b>0,03</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 0,07 %)</b>			
3.072	LyondellBasell Industries NV	268.677	0,07
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>268.677</b>	<b>0,07</b>
<b>Panama (30. Juni 2021: 0,06 %)</b>			
10.132	Carnival Corp	87.642	0,02
<b>Panama insgesamt</b>		<b>87.642</b>	<b>0,02</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 0,35 %)</b>			
4.504	Chubb Ltd	885.396	0,23
1.762	Garmin Ltd	173.117	0,05
3.820	TE Connectivity Ltd	432.233	0,11
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>1.490.746</b>	<b>0,39</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 0,12 %)</b>			
1.680	Atlassian Corp Plc	314.832	0,08
3.873	Royalty Pharma Plc - Class A	162.821	0,04
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>477.653</b>	<b>0,12</b>

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %)</b>			
6.976	3M Co	902.764	0,23
1.686	A O Smith Corp	92.190	0,02
21.084	Abbott Laboratories	2.290.777	0,59
21.087	AbbVie Inc	3.229.685	0,84
543	ABIOMED Inc	134.398	0,04
8.902	Activision Blizzard Inc	693.110	0,18
5.657	Adobe Inc	2.070.801	0,54
700	Advance Auto Parts Inc	121.163	0,03
19.477	Advanced Micro Devices Inc	1.489.406	0,39
2.300	Affirm Holdings Inc	41.538	0,01
6.967	Aflac Inc	385.484	0,10
3.554	Agilent Technologies Inc	422.109	0,11
2.613	Air Products & Chemicals Inc	628.374	0,16
3.991	Airbnb Inc	355.518	0,09
1.858	Akamai Technologies Inc	169.691	0,04
1.400	Albemarle Corp	292.572	0,08
1.899	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	275.412	0,07
919	Align Technology Inc	217.500	0,06
148	Alleghany Corp	123.299	0,03
2.955	Alliant Energy Corp	173.193	0,05
3.227	Allstate Corp/The	408.958	0,11
4.063	Ally Financial Inc	136.151	0,04
1.424	Alnylam Pharmaceuticals Inc	207.690	0,05
3.073	Alphabet Inc	6.722.034	1,74
3.745	Alphabet Inc - Class A	8.161.329	2,12
21.824	Altria Group Inc	911.588	0,24
104.914	Amazon.com Inc	11.142.916	2,89
2.830	Ameren Corp	255.719	0,07

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
6.650	American Express Co	921.823	0,24
9.833	American International Group Inc	502.761	0,13
5.581	American Tower Corp (REIT)	1.426.448	0,37
2.254	American Water Works Co Inc	335.328	0,09
1.314	Ameriprise Financial Inc	312.312	0,08
1.843	AmerisourceBergen Corp - Class A	260.748	0,07
2.604	AMETEK Inc	286.154	0,07
6.376	Amgen Inc	1.551.281	0,40
6.938	Amphenol Corp - Class A	446.668	0,12
6.189	Analog Devices Inc	904.151	0,23
18.720	Annaly Capital Management Inc (REIT)	110.635	0,03
985	ANSYS Inc	235.701	0,06
5.538	Apollo Global Management Inc	268.482	0,07
195.184	Apple Inc	26.685.556	6,92
10.529	Applied Materials Inc	957.928	0,25
1.321	AppLovin Corp - Class A	45.495	0,01
6.697	Archer-Daniels-Midland Co	519.687	0,13
2.885	Arista Networks Inc	270.440	0,07
2.458	Arthur J Gallagher & Co	400.752	0,10
85.520	AT&T Inc	1.792.499	0,46
1.649	Atmos Energy Corp	184.853	0,05
2.566	Autodesk Inc	441.249	0,11
5.004	Automatic Data Processing Inc	1.051.040	0,27
236	AutoZone Inc	507.192	0,13
1.616	AvalonBay Communities Inc (REIT)	313.908	0,08
834	Avangrid Inc	38.464	0,01
6.476	Avantor Inc	201.404	0,05
10.588	Baker Hughes Co - Class A	305.676	0,08

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
3.835	Ball Corp	263.733	0,07
84.995	Bank of America Corp	2.645.894	0,69
8.758	Bank of New York Mellon Corp/The	365.296	0,09
5.946	Baxter International Inc	381.912	0,10
3.363	Becton Dickinson and Co	829.080	0,22
15.312	Berkshire Hathaway Inc - Class B	4.180.482	1,08
2.359	Best Buy Co Inc	153.783	0,04
1.288	Bill.com Holdings Inc	141.603	0,04
1.717	Biogen Inc	350.165	0,09
2.139	BioMarin Pharmaceutical Inc	177.259	0,05
1.739	BlackRock Inc	1.059.121	0,27
8.328	Blackstone Inc	759.763	0,20
6.196	Block Inc	380.806	0,10
7.033	Boeing Co/The	961.552	0,25
485	Booking Holdings Inc	848.260	0,22
1.718	Boston Properties Inc (REIT)	152.868	0,04
17.041	Boston Scientific Corp	635.118	0,16
25.140	Bristol-Myers Squibb Co	1.935.780	0,50
4.719	Broadcom Inc	2.292.537	0,59
1.393	Broadridge Financial Solutions Inc	198.572	0,05
3.539	Brown-Forman Corp	248.296	0,06
465	Brown-Forman Corp	31.453	0,01
784	Burlington Stores Inc	106.804	0,03
3.246	Cadence Design Systems Inc	486.997	0,13
2.588	Caesars Entertainment Inc	99.120	0,03
2.341	Campbell Soup Co	112.485	0,03
4.770	Capital One Financial Corp	496.986	0,13
3.229	Cardinal Health Inc	168.780	0,04

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
1.920	CarMax Inc	173.722	0,05
10.296	Carrier Global Corp	367.155	0,10
1.088	Carvana Co - Class A	24.567	0,01
1.990	Catalent Inc	213.507	0,06
6.454	Caterpillar Inc	1.153.717	0,30
1.223	Cboe Global Markets Inc	138.431	0,04
3.914	CBRE Group Inc - Class A	288.110	0,07
1.578	CDW Corp/DE	248.630	0,06
1.280	Celanese Corp - Class A	150.541	0,04
6.828	Centene Corp	577.717	0,15
7.573	CenterPoint Energy Inc	224.009	0,06
1.491	CH Robinson Worldwide Inc	151.143	0,04
18.111	Charles Schwab Corp/The	1.144.253	0,30
1.378	Charter Communications Inc	645.634	0,17
2.697	Cheniere Energy Inc	358.782	0,09
23.095	Chevron Corp	3.343.694	0,87
1.056	Chewy Inc - Class A	36.664	0,01
315	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	411.787	0,11
2.606	Church & Dwight Co Inc	241.472	0,06
3.823	Cigna Corp	1.007.437	0,26
1.800	Cincinnati Financial Corp	214.164	0,06
1.043	Cintas Corp	389.592	0,10
45.869	Cisco Systems Inc	1.955.854	0,51
23.517	Citigroup Inc	1.081.547	0,28
5.705	Citizens Financial Group Inc	203.611	0,05
1.395	Citrix Systems Inc	135.552	0,04
1.422	Clorox Co/The	200.474	0,05
3.018	Cloudflare Inc	132.037	0,03

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
4.234	CME Group Inc	866.700	0,22
3.258	CMS Energy Corp	219.915	0,06
46.610	Coca-Cola Co/The	2.932.235	0,76
6.220	Cognizant Technology Solutions Corp	419.788	0,11
1.662	Coinbase Global Inc	78.147	0,02
10.001	Colgate-Palmolive Co	801.480	0,21
53.846	Comcast Corp	2.112.917	0,55
5.386	Conagra Brands Inc	184.417	0,05
15.811	ConocoPhillips	1.419.986	0,37
4.309	Consolidated Edison Inc	409.786	0,11
1.815	Constellation Brands Inc - Class A	423.004	0,11
3.957	Constellation Energy Corp	226.578	0,06
581	Cooper Cos Inc/The	181.923	0,05
2.587	Copart Inc	281.103	0,07
8.984	Corning Inc	283.086	0,07
8.546	Corteva Inc	462.680	0,12
4.620	CoStar Group Inc	279.094	0,07
5.314	Costco Wholesale Corp	2.546.894	0,66
9.548	Coupang Inc	121.737	0,03
2.429	CrowdStrike Holdings Inc	409.432	0,11
5.166	Crown Castle International Corp (REIT)	869.851	0,23
25.779	CSX Corp	749.138	0,19
1.654	Cummins Inc	320.099	0,08
15.817	CVS Health Corp	1.465.603	0,38
7.828	Danaher Corp	1.984.555	0,51
1.442	Darden Restaurants Inc	163.119	0,04
3.009	Datadog Inc	286.577	0,07
671	DaVita Inc	53.653	0,01
3.347	Deere & Co	1.002.326	0,26

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
3.378	Dell Technologies Inc	156.097	0,04
7.659	Delta Air Lines Inc	221.881	0,06
2.527	DENTSPLY SIRONA Inc	90.290	0,02
7.936	Devon Energy Corp	437.353	0,11
4.677	Dexcom Inc	348.577	0,09
2.112	Diamondback Energy Inc	255.869	0,07
3.383	Digital Realty Trust Inc (REIT)	439.215	0,11
3.290	Discover Financial Services	311.168	0,08
3.063	DISH Network Corp - Class A	54.920	0,01
2.279	DocuSign Inc - Class A	130.769	0,03
2.738	Dollar General Corp	672.015	0,17
2.673	Dollar Tree Inc	416.587	0,11
9.596	Dominion Energy Inc	765.857	0,20
422	Domino's Pizza Inc	164.458	0,04
2.315	DoorDash Inc	148.554	0,04
1.648	Dover Corp	199.935	0,05
8.731	Dow Inc	450.607	0,12
4.039	DR Horton Inc	267.341	0,07
2.188	DTE Energy Co	277.329	0,07
9.179	Duke Energy Corp	984.081	0,26
4.534	Duke Realty Corp (REIT)	249.143	0,06
5.532	DuPont de Nemours Inc	307.469	0,08
1.484	Eastman Chemical Co	133.219	0,03
6.561	eBay Inc	273.397	0,07
3.024	Ecolab Inc	464.970	0,12
4.567	Edison International	288.817	0,08
7.377	Edwards Lifesciences Corp	701.479	0,18
5.073	Elanco Animal Health Inc	99.583	0,03
3.277	Electronic Arts Inc	398.647	0,10

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
2.925	Elevance Health Inc	1.411.547	0,37
10.117	Eli Lilly & Co	3.280.235	0,85
6.909	Emerson Electric Co	549.542	0,14
1.468	Enphase Energy Inc	286.612	0,07
2.422	Entergy Corp	272.814	0,07
6.966	EOG Resources Inc	769.325	0,20
662	EPAM Systems Inc	195.144	0,05
1.453	Equifax Inc	265.579	0,07
1.081	Equinix Inc (REIT)	710.239	0,18
4.332	Equity Residential (REIT)	312.857	0,08
759	Essex Property Trust Inc (REIT)	198.486	0,05
2.531	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	644.570	0,17
1.520	Etsy Inc	111.279	0,03
4.054	Eversource Energy	342.441	0,09
2.037	Exact Sciences Corp	80.237	0,02
11.917	Exelon Corp	540.078	0,14
1.765	Expedia Group Inc	167.375	0,04
1.889	Expeditors International of Washington Inc	184.102	0,05
1.586	Extra Space Storage Inc (REIT)	269.810	0,07
50.459	Exxon Mobil Corp	4.321.309	1,12
730	F5 Inc	111.719	0,03
6.807	Fastenal Co	339.805	0,09
2.839	FedEx Corp	643.630	0,17
3.378	Fidelity National Financial Inc	124.851	0,03
7.135	Fidelity National Information Services Inc	654.065	0,17
8.179	Fifth Third Bancorp	274.814	0,07
2.084	First Republic Bank/CA	300.513	0,08
6.685	FirstEnergy Corp	256.637	0,07
7.062	Fiserv Inc	628.306	0,16

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
901	FleetCor Technologies Inc	189.309	0,05
1.482	FMC Corp	158.589	0,04
46.630	Ford Motor Co	518.992	0,13
8.125	Fortinet Inc	459.713	0,12
4.110	Fortive Corp	223.502	0,06
1.673	Fortune Brands Home & Security Inc	100.179	0,03
5.179	Fox Corp	166.557	0,04
3.506	Franklin Resources Inc	81.725	0,02
17.352	Freeport-McMoRan Inc	507.720	0,13
970	Gartner Inc	234.575	0,06
750	Generac Holdings Inc	157.935	0,04
2.894	General Dynamics Corp	640.297	0,17
12.916	General Electric Co	822.362	0,21
7.014	General Mills Inc	529.206	0,14
15.523	General Motors Co	493.010	0,13
1.697	Genuine Parts Co	225.701	0,06
14.792	Gilead Sciences Inc	914.294	0,24
3.335	Global Payments Inc	368.984	0,10
1.015	Globe Life Inc	98.932	0,03
4.090	Goldman Sachs Group Inc/The	1.214.812	0,32
9.984	Halliburton Co	313.098	0,08
3.861	Hartford Financial Services Group Inc/The	252.625	0,07
1.431	Hasbro Inc	117.170	0,03
2.754	HCA Healthcare Inc	462.837	0,12
6.341	Healthpeak Properties Inc (REIT)	164.295	0,04
1.593	Henry Schein Inc	122.247	0,03
1.673	Hershey Co/The	359.963	0,09
3.442	Hess Corp	364.645	0,09
15.759	Hewlett Packard Enterprise Co	208.964	0,05

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
3.255	Hilton Worldwide Holdings Inc	362.737	0,09
2.949	Hologic Inc	204.366	0,05
12.421	Home Depot Inc/The	3.406.708	0,88
8.280	Honeywell International Inc	1.439.147	0,37
3.181	Hormel Foods Corp	150.652	0,04
8.639	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	135.460	0,04
12.670	HP Inc	415.323	0,11
535	HubSpot Inc	160.848	0,04
1.491	Humana Inc	697.892	0,18
16.016	Huntington Bancshares Inc/OH	192.672	0,05
887	IAC/InterActiveCorp	67.385	0,02
996	IDEXX Laboratories Inc	349.327	0,09
3.328	Illinois Tool Works Inc	606.528	0,16
1.863	Illumina Inc	343.463	0,09
2.086	Incyte Corp	158.473	0,04
4.759	Ingersoll Rand Inc	200.259	0,05
49.025	Intel Corp	1.834.025	0,48
1.081	Interactive Brokers Group Inc	59.466	0,02
6.577	Intercontinental Exchange Inc	618.501	0,16
10.788	International Business Machines Corp	1.523.158	0,40
3.027	International Flavors & Fragrances Inc	360.576	0,09
4.485	International Paper Co	187.608	0,05
3.335	Intuit Inc	1.285.442	0,33
4.285	Intuitive Surgical Inc	860.042	0,22
7.009	Invitation Homes Inc (REIT)	249.380	0,06
2.233	IQVIA Holdings Inc	484.539	0,13
3.573	Iron Mountain Inc (REIT)	173.969	0,05
1.187	J M Smucker Co/The	151.948	0,04
965	JB Hunt Transport Services Inc	151.959	0,04

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
31.311	Johnson & Johnson	5.558.016	1,44
35.021	JPMorgan Chase & Co	3.943.715	1,02
2.901	Kellogg Co	206.957	0,05
10.121	Keurig Dr Pepper Inc	358.182	0,09
10.286	KeyCorp	177.228	0,05
2.079	Keysight Technologies Inc	286.590	0,07
3.944	Kimberly-Clark Corp	533.032	0,14
23.065	Kinder Morgan Inc	386.569	0,10
6.905	KKR & Co Inc	319.632	0,08
1.808	KLA Corp	576.897	0,15
8.209	Kraft Heinz Co/The	313.091	0,08
7.838	Kroger Co/The	370.973	0,10
2.293	L3Harris Technologies Inc	554.218	0,14
1.090	Laboratory Corp of America Holdings	255.452	0,07
1.663	Lam Research Corp	708.687	0,18
5.469	Las Vegas Sands Corp	183.704	0,05
1.572	Leidos Holdings Inc	158.316	0,04
2.043	Lennar Corp	119.945	0,03
1.622	Lennar Corp	114.465	0,03
1.522	Liberty Broadband Corp	176.004	0,05
211	Liberty Broadband Corp	23.959	0,01
1.960	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	70.658	0,02
491	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	17.696	0,00
1.782	Live Nation Entertainment Inc	147.158	0,04
3.086	LKQ Corp	151.492	0,04
3.218	Lockheed Martin Corp	1.383.611	0,36
2.532	Loews Corp	150.046	0,04
7.996	Lowe's Cos Inc	1.396.661	0,36
6.529	Lucid Group Inc	112.038	0,03

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
1.404	Lululemon Athletica Inc	382.744	0,10
12.152	Lumen Technologies Inc	132.578	0,03
3.274	Lyft Inc	43.479	0,01
2.118	M&T Bank Corp	337.588	0,09
6.587	Marathon Petroleum Corp	541.517	0,14
155	Markel Corp	200.454	0,05
3.339	Marriott International Inc/MD	454.137	0,12
5.968	Marsh & McLennan Cos Inc	926.532	0,24
716	Martin Marietta Materials Inc	214.256	0,06
10.137	Marvell Technology Inc	441.264	0,11
2.952	Masco Corp	149.371	0,04
10.316	Mastercard Inc	3.254.492	0,84
3.158	Match Group Inc	220.081	0,06
2.870	McCormick & Co Inc/MD	238.927	0,06
8.942	McDonald's Corp	2.207.601	0,57
1.792	McKesson Corp	584.568	0,15
575	MercadoLibre Inc	366.200	0,10
30.011	Merck & Co Inc	2.736.103	0,71
27.478	Meta Platforms Inc - Class A	4.430.827	1,15
7.476	MetLife Inc	469.418	0,12
273	Mettler-Toledo International Inc	313.614	0,08
4.280	MGM Resorts International	123.906	0,03
6.475	Microchip Technology Inc	376.068	0,10
13.307	Micron Technology Inc	735.611	0,19
88.362	Microsoft Corp	22.694.012	5,88
1.356	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	236.853	0,06
4.288	Moderna Inc	612.541	0,16
2.343	Molson Coors Beverage Co - Class B	127.717	0,03
16.350	Mondelez International Inc	1.015.171	0,26

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
762	MongoDB Inc - Class A	197.739	0,05
4.467	Monster Beverage Corp	414.091	0,11
1.898	Moody's Corp	516.199	0,13
16.376	Morgan Stanley	1.245.559	0,32
4.364	Mosaic Co/The	206.112	0,05
2.000	Motorola Solutions Inc	419.200	0,11
944	MSCI Inc - Class A	389.070	0,10
1.291	Nasdaq Inc	196.929	0,05
2.614	NetApp Inc	170.537	0,04
5.209	Netflix Inc	910.898	0,24
4.562	Newell Brands Inc	86.860	0,02
9.431	Newmont Corp	562.748	0,15
23.737	NextEra Energy Inc	1.838.668	0,48
15.133	NIKE Inc	1.546.593	0,40
5.044	NiSource Inc	148.748	0,04
3.066	Norfolk Southern Corp	696.871	0,18
2.362	Northern Trust Corp	227.886	0,06
1.676	Northrop Grumman Corp	802.083	0,21
6.413	NortonLifeLock Inc	140.829	0,04
3.236	Nucor Corp	337.871	0,09
33.783	NVIDIA Corp	5.121.165	1,33
38	NVR Inc	152.157	0,04
10.655	Occidental Petroleum Corp	627.366	0,16
1.754	Okta Inc	158.562	0,04
1.232	Old Dominion Freight Line Inc	315.737	0,08
2.389	Omnicom Group Inc	151.964	0,04
5.125	ONEOK Inc	284.438	0,07
18.237	Oracle Corp	1.274.219	0,33
777	O'Reilly Automotive Inc	490.878	0,13

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
2.990	Organon & Co	100.913	0,03
5.010	Otis Worldwide Corp	354.057	0,09
3.765	PACCAR Inc	310.010	0,08
1.148	Packaging Corp of America	157.850	0,04
20.206	Palantir Technologies Inc	183.268	0,05
1.145	Palo Alto Networks Inc	565.561	0,15
870	Paramount Global	23.716	0,01
6.011	Paramount Global - Class B	148.351	0,04
1.524	Parker-Hannifin Corp	374.980	0,10
3.840	Paychex Inc	437.261	0,11
598	Paycom Software Inc	167.512	0,04
13.857	PayPal Holdings Inc	967.773	0,25
16.571	PepsiCo Inc	2.761.723	0,72
67.646	Pfizer Inc	3.546.680	0,92
18.551	Philip Morris International Inc	1.831.726	0,48
5.665	Phillips 66	464.473	0,12
1.292	Pinnacle West Capital Corp	94.471	0,02
6.666	Pinterest Inc	121.055	0,03
2.733	Pioneer Natural Resources Co	609.678	0,16
4.919	PNC Financial Services Group Inc/The	776.071	0,20
2.783	PPG Industries Inc	318.208	0,08
8.375	PPL Corp	227.214	0,06
3.036	Principal Financial Group Inc	202.774	0,05
28.555	Procter & Gamble Co/The	4.105.923	1,06
6.927	Progressive Corp/The	805.402	0,21
8.821	Prologis Inc (REIT)	1.037.791	0,27
4.550	Prudential Financial Inc	435.344	0,11
5.877	Public Service Enterprise Group Inc	371.897	0,10

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
1.811	Public Storage (REIT)	566.245	0,15
3.055	PulteGroup Inc	121.070	0,03
1.233	Qorvo Inc	116.297	0,03
13.548	QUALCOMM Inc	1.730.622	0,45
1.204	Qualtrics International Inc - Class A	15.062	0,00
1.388	Quest Diagnostics Inc	184.576	0,05
2.234	Raymond James Financial Inc	199.742	0,05
18.018	Raytheon Technologies Corp	1.731.710	0,45
7.047	Realty Income Corp (REIT)	481.028	0,12
1.230	Regeneron Pharmaceuticals Inc	727.090	0,19
11.068	Regions Financial Corp	207.525	0,05
2.514	Republic Services Inc - Class A	329.007	0,09
1.721	ResMed Inc	360.773	0,09
1.109	RingCentral Inc - Class A	57.956	0,02
2.194	Rivian Automotive Inc	56.474	0,01
6.944	Robinhood Markets Inc	57.080	0,01
3.515	ROBLOX Corp	115.503	0,03
1.793	Rocket Cos Inc	13.196	0,00
1.348	Rockwell Automation Inc	268.670	0,07
1.421	Roku Inc	116.721	0,03
2.935	Rollins Inc	102.490	0,03
1.219	Roper Technologies Inc	481.078	0,12
4.059	Ross Stores Inc	285.064	0,07
4.170	S&P Global Inc	1.405.540	0,36
11.521	Salesforce Inc	1.901.426	0,49
1.295	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	414.465	0,11
1.603	Seagen Inc	283.635	0,07
3.799	Sempra Energy	570.876	0,15

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
2.375	ServiceNow Inc	1.129.360	0,29
2.858	Sherwin-Williams Co/The	639.935	0,17
3.933	Simon Property Group Inc (REIT)	373.320	0,10
7.769	Sirius XM Holdings Inc	47.624	0,01
1.856	Skyworks Solutions Inc	171.940	0,04
12.969	Snap Inc	170.283	0,04
612	Snap-on Inc	120.582	0,03
3.162	Snowflake Inc	439.708	0,11
12.738	Southern Co/The (Units)	908.347	0,24
1.047	Southern Copper Corp	52.151	0,01
6.789	Southwest Airlines Co	245.219	0,06
1.896	Splunk Inc	167.720	0,04
2.606	SS&C Technologies Holdings Inc	151.330	0,04
1.922	Stanley Black & Decker Inc	201.541	0,05
13.640	Starbucks Corp	1.041.960	0,27
4.142	State Street Corp	255.354	0,07
3.960	Stryker Corp	787.763	0,20
694	SVB Financial Group	274.123	0,07
5.960	Synchrony Financial	164.615	0,04
1.804	Synopsys Inc	547.875	0,14
6.010	Sysco Corp	509.107	0,13
2.626	T Rowe Price Group Inc	298.340	0,08
1.325	Take-Two Interactive Software Inc	162.352	0,04
5.505	Target Corp	777.471	0,20
1.634	Teladoc Health Inc	54.265	0,01
554	Teleflex Inc	136.201	0,04
1.912	Teradyne Inc	171.220	0,04
10.110	Tesla Inc	6.808.276	1,77
11.002	Texas Instruments Inc	1.690.457	0,44

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
2.594	Textron Inc	158.416	0,04
4.694	Thermo Fisher Scientific Inc	2.550.156	0,66
13.033	TJX Cos Inc/The	727.893	0,19
7.800	T-Mobile US Inc	1.049.412	0,27
1.321	Tractor Supply Co	256.076	0,07
5.193	Trade Desk Inc/The - Class A	217.535	0,06
629	TransDigm Group Inc	337.565	0,09
2.260	TransUnion	180.777	0,05
2.815	Travelers Cos Inc/The	476.101	0,12
2.972	Trimble Inc	173.060	0,05
15.702	Truist Financial Corp	744.746	0,19
2.036	Twilio Inc - Class A	170.637	0,04
8.272	Twitter Inc	309.290	0,08
3.436	Tyson Foods Inc - Class A	295.702	0,08
21.465	Uber Technologies Inc	439.174	0,11
3.829	UDR Inc (REIT)	176.287	0,05
3.547	UiPath Inc	64.520	0,02
610	Ulta Beauty Inc	235.143	0,06
7.535	Union Pacific Corp	1.607.065	0,42
3.871	United Airlines Holdings Inc	137.111	0,04
8.794	United Parcel Service Inc - Class B	1.605.257	0,42
877	United Rentals Inc	213.032	0,06
11.216	UnitedHealth Group Inc	5.760.874	1,49
2.358	Unity Software Inc	86.822	0,02
748	Universal Health Services Inc	75.331	0,02
15.778	US Bancorp	726.104	0,19
450	Vail Resorts Inc	98.123	0,03
4.857	Valero Energy Corp	516.202	0,13

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
1.597	Veeva Systems Inc - Class A	316.270	0,08
4.765	Ventas Inc (REIT)	245.064	0,06
1.139	VeriSign Inc	190.589	0,05
1.846	Verisk Analytics Inc - Class A	319.524	0,08
49.803	Verizon Communications Inc	2.527.502	0,66
3.025	Vertex Pharmaceuticals Inc	852.415	0,22
4.041	VF Corp	178.491	0,05
14.123	Viatis Inc	147.868	0,04
19.777	Visa Inc - Class A	3.893.894	1,01
2.443	VMware Inc	278.453	0,07
1.516	Vulcan Materials Co	215.424	0,06
2.364	W R Berkley Corp	161.367	0,04
8.381	Walgreens Boots Alliance Inc	317.640	0,08
17.189	Walmart Inc	2.089.839	0,54
21.927	Walt Disney Co/The	2.069.909	0,54
26.106	Warner Bros Discovery Inc	350.343	0,09
1.395	Warner Music Group Corp - Class A	33.982	0,01
4.993	Waste Management Inc	763.829	0,20
721	Waters Corp	238.637	0,06
979	Wayfair Inc	42.645	0,01
3.817	WEC Energy Group Inc	384.143	0,10
5.414	Welltower Inc (REIT)	445.843	0,12
865	West Pharmaceutical Services Inc	261.550	0,07
3.668	Western Digital Corp	164.436	0,04
2.121	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	174.092	0,05
3.294	Westrock Co	131.233	0,03
8.978	Weyerhaeuser Co (REIT)	297.351	0,08
697	Whirlpool Corp	107.944	0,03

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,90 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 96,54 %) (Fortsetzung)</b>			
14.204	Williams Cos Inc/The	443.307	0,12
2.268	Workday Inc - Class A	316.567	0,08
2.208	WP Carey Inc (REIT)	182.955	0,05
543	WW Grainger Inc	246.755	0,06
6.395	Xcel Energy Inc	452.510	0,12
2.129	Xylem Inc/NY	166.445	0,04
4.830	Yum China Holdings Inc	234.255	0,06
3.380	Yum! Brands Inc	383.664	0,10
610	Zebra Technologies Corp	179.310	0,05
1.363	Zillow Group Inc	43.275	0,01
1.273	Zillow Group Inc - Class A	40.494	0,01
2.478	Zimmer Biomet Holdings Inc	260.339	0,07
5.698	Zoetis Inc	979.429	0,25
2.511	Zoom Video Communications Inc - Class A	271.113	0,07
3.256	ZoomInfo Technologies Inc - Class A	108.229	0,03
981	Zscaler Inc	146.669	0,04
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>372.729.419</b>	<b>96,62</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>385.283.834</b>	<b>99,87</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	385.283.834	99,87
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	493.618	0,13
		<b>385.777.452</b>	<b>100,00</b>

**L&G US Equity UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2022

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,87
Sonstige Vermögenswerte	0,13
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

**L&G UK Equity UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,64 %)</b>			
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,48 %)</b>			
7.928	Farfetch Ltd	46.741	0,10
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>46.741</b>	<b>0,10</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 0,29 %)</b>			
	DCC Plc	115.877	0,26
<b>Irland insgesamt</b>		<b>115.877</b>	<b>0,26</b>
<b>Isle of Man (30. Juni 2021: 0,56 %)</b>			
14.448	Entain Plc	179.878	0,40
<b>Isle of Man insgesamt</b>		<b>179.878</b>	<b>0,40</b>
<b>Jersey (30. Juni 2021: 5,63 %)</b>			
22.527	Experian Plc	542.000	1,20
5.290	Ferguson Plc	486.045	1,07
255.763	Glencore Plc	1.138.401	2,52
26.849	WPP Plc	221.397	0,49
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>2.387.843</b>	<b>5,28</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: – %)</b>			
22.422	B&M European Value Retail SA	82.221	0,18
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>82.221</b>	<b>0,18</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 0,64 %)</b>			
24.103	CNH Industrial NV	228.653	0,50
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>228.653</b>	<b>0,50</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: 0,37 %)</b>			
90.629	International Consolidated Airlines Group SA	97.535	0,22
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>97.535</b>	<b>0,22</b>

## L&amp;G UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,64 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 91,66 %)</b>			
23.202	3i Group Plc	257.194	0,57
54.704	abrdn plc	87.444	0,19
5.761	Admiral Group Plc	129.277	0,29
9.577	Allfunds Group Plc	60.678	0,13
30.458	Anglo American Plc	894.551	1,98
8.272	Antofagasta Plc	95.542	0,21
10.870	Ashtead Group Plc	373.819	0,83
8.514	Associated British Foods Plc	134.351	0,30
36.551	AstraZeneca Plc	3.947.508	8,72
21.669	Auto Trader Group Plc '144A'	120.263	0,27
14.999	Avast Plc '144A'	77.545	0,17
2.655	AVEVA Group Plc	59.764	0,13
67.351	Aviva Plc	270.280	0,60
76.897	BAE Systems Plc	638.399	1,41
410.507	Barclays Plc	628.568	1,39
25.262	Barratt Developments Plc	115.548	0,25
2.580	Berkeley Group Holdings Plc	96.079	0,21
435.310	BP Plc	1.690.309	3,74
55.533	British American Tobacco Plc	1.954.484	4,32
21.862	British Land Co Plc/The (REIT)	97.745	0,22
168.110	BT Group Plc	313.189	0,69
8.125	Bunzl Plc	220.919	0,49
9.821	Burberry Group Plc	161.163	0,36
3.716	Carnival Plc	23.024	0,05
3.634	Coca-Cola Europacific Partners Plc	154.433	0,34
43.613	Compass Group Plc	732.698	1,62
39.027	ConvaTec Group Plc '144A'	87.577	0,19
3.396	Croda International Plc	219.789	0,49
7.745	Darktrace Plc	22.817	0,05

## L&amp;G UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,64 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 91,66 %) (Fortsetzung)</b>			
56.269	Diageo Plc	1.986.577	4,39
31.323	Direct Line Insurance Group Plc	78.840	0,17
32.937	DS Smith Plc	91.334	0,20
16.074	easyJet Plc	58.927	0,13
687	Endava Plc ADR	49.933	0,11
5.149	Evraz Plc*	–	–
4.403	Fresnillo Plc	33.762	0,07
123.944	GlaxoSmithKline Plc	2.188.355	4,84
9.174	Halma Plc	184.306	0,41
8.426	Hargreaves Lansdown Plc	66.380	0,15
3.204	Hikma Pharmaceuticals Plc	51.825	0,11
492.662	HSBC Holdings Plc	2.638.698	5,83
22.880	Imperial Brands Plc	420.077	0,93
35.882	Informa Plc	189.744	0,42
4.365	InterContinental Hotels Group Plc	189.877	0,42
7.012	Intermediate Capital Group Plc	91.787	0,20
3.865	Intertek Group Plc	162.562	0,36
87.070	ITV Plc	56.822	0,13
46.506	J Sainsbury Plc	94.872	0,21
62.115	JD Sports Fashion Plc	71.681	0,16
4.458	Johnson Matthey Plc	85.839	0,19
49.941	Kingfisher Plc	122.006	0,27
18.211	Land Securities Group Plc (REIT)	120.921	0,27
147.966	Legal & General Group Plc	354.379	0,78
10.415	Liberty Global Plc	189.442	0,42
1.128	Liberty Global Plc	19.552	0,04
1.706.773	Lloyds Banking Group Plc	722.136	1,60
8.337	London Stock Exchange Group Plc	636.280	1,41
62.763	M&G Plc	122.137	0,27

## L&amp;G UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,64 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 91,66 %) (Fortsetzung)</b>			
18.804	Meggitt Plc	148.364	0,33
106.740	Melrose Industries Plc	159.790	0,35
11.907	Mondi Plc	173.247	0,38
88.725	National Grid Plc	933.387	2,06
133.168	NatWest Group Plc	290.706	0,64
2.925	Next Plc	171.405	0,38
658	NMC Health Plc*	–	–
12.274	Ocado Group Plc	95.884	0,21
17.989	Pearson Plc	134.881	0,30
7.368	Persimmon Plc	137.266	0,30
17.436	Phoenix Group Holdings Plc	102.942	0,23
67.299	Prudential Plc	683.758	1,51
17.273	Reckitt Benckiser Group Plc	1.065.744	2,35
47.076	RELX Plc	1.047.912	2,32
45.363	Rentokil Initial Plc	215.293	0,48
19.816	Rightmove Plc	112.634	0,25
25.992	Rio Tinto Plc	1.277.897	2,82
203.269	Rolls-Royce Holdings Plc	168.612	0,37
23.972	Sage Group Plc/The	152.174	0,34
2.858	Schroders Plc	76.366	0,17
29.584	Segro Plc (REIT)	288.976	0,64
5.962	Severn Trent Plc	162.107	0,36
184.033	Shell Plc	3.927.264	8,68
21.228	Smith & Nephew Plc	243.591	0,54
9.145	Smiths Group Plc	127.984	0,28
1.777	Spirax-Sarco Engineering Plc	175.532	0,39
25.986	SSE Plc	419.934	0,93
13.341	St James's Place Plc	147.084	0,32
73.547	Standard Chartered Plc	454.962	1,01

## L&G UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,64 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 91,66 %) (Fortsetzung)</b>			
87.948	Taylor Wimpey Plc	102.591	0,23
183.387	Tesco Plc	468.554	1,04
61.297	Unilever Plc	2.280.861	5,04
16.197	United Utilities Group Plc	165.209	0,36
689.404	Vodafone Group Plc	873.199	1,93
6.356	Weir Group Plc/The	86.632	0,19
5.005	Whitbread Plc	124.024	0,27
11.062	Wise Plc - Class A	32.898	0,07
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>41.973.672</b>	<b>92,77</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>45.112.420</b>	<b>99,71</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	45.112.420	99,71
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	131.414	0,29
		<b>45.243.834</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,71
	Sonstige Vermögenswerte		0,29
			<b>100,00</b>
	Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

\*Diese Wertpapiere werden mit Null bewertet

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %)</b>			
2.200	ABC-Mart Inc	97.162	0,03
30.700	Acom Co Ltd	71.634	0,03
16.400	Advantest Corp	876.405	0,31
60.100	Aeon Co Ltd	1.041.371	0,37
5.900	Aeon Mall Co Ltd	72.048	0,03
17.100	AGC Inc	600.398	0,21
15.200	Air Water Inc	190.650	0,07
13.400	Aisin Corp	414.265	0,15
44.900	Ajinomoto Co Inc	1.090.648	0,39
15.400	Alfresa Holdings Corp	206.875	0,07
26.000	Amada Co Ltd	190.806	0,07
37.400	ANA Holdings Inc	688.096	0,24
41.400	Asahi Group Holdings Ltd	1.354.555	0,48
19.000	Asahi Intecc Co Ltd	286.423	0,10
115.000	Asahi Kasei Corp	876.964	0,31
154.100	Astellas Pharma Inc	2.399.040	0,85
11.222	Azbil Corp	294.479	0,10
15.100	Bandai Namco Holdings Inc	1.064.686	0,38
1.210	BayCurrent Consulting Inc	321.527	0,11
7.179	Benefit One Inc	96.386	0,03
49.000	Bridgestone Corp	1.785.359	0,63
19.100	Brother Industries Ltd	335.310	0,12
5.400	Calbee Inc	108.751	0,04
86.300	Canon Inc	1.959.703	0,69
13.778	Capcom Co Ltd	334.169	0,12
19.700	Casio Computer Co Ltd	182.565	0,06
14.400	Central Japan Railway Co	1.659.357	0,59
56.000	Chiba Bank Ltd/The	305.443	0,11

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
61.900	Chubu Electric Power Co Inc	622.394	0,22
53.900	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	1.376.711	0,49
10.600	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	126.399	0,04
88.900	Concordia Financial Group Ltd	307.556	0,11
1.400	Cosmos Pharmaceutical Corp	134.276	0,05
35.400	CyberAgent Inc	352.033	0,12
19.700	Dai Nippon Printing Co Ltd	424.292	0,15
9.700	Daifuku Co Ltd	554.061	0,20
87.800	Dai-ichi Life Holdings Inc	1.622.156	0,57
161.500	Daiichi Sankyo Co Ltd	4.085.794	1,45
22.600	Daikin Industries Ltd	3.618.196	1,28
5.100	Daito Trust Construction Co Ltd	439.594	0,16
51.300	Daiwa House Industry Co Ltd	1.193.998	0,42
166	Daiwa House REIT Investment Corp (REIT)	375.732	0,13
120.300	Daiwa Securities Group Inc	536.615	0,19
36.900	Denso Corp	1.957.787	0,69
18.100	Dentsu Group Inc	542.913	0,19
2.500	Disco Corp	592.544	0,21
27.400	East Japan Railway Co	1.399.295	0,50
7.900	Ebara Corp	295.403	0,10
22.900	Eisai Co Ltd	965.018	0,34
262.400	ENEOS Holdings Inc	992.197	0,35
2.700	Ezaki Glico Co Ltd	78.006	0,03
16.300	FANUC Corp	2.548.394	0,90
4.700	Fast Retailing Co Ltd	2.459.063	0,87
9.699	Food & Life Cos Ltd	206.752	0,07
10.800	Fuji Electric Co Ltd	446.770	0,16
9.700	Fuji Media Holdings Inc	82.038	0,03

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
31.600	FUJIFILM Holdings Corp	1.692.870	0,60
16.200	Fujitsu Ltd	2.022.988	0,72
14.900	Fukuoka Financial Group Inc	268.048	0,09
349	GLP J-Reit (REIT)	425.669	0,15
3.800	GMO Payment Gateway Inc	267.123	0,09
17.400	Hakuhodo DY Holdings Inc	159.457	0,06
12.000	Hamamatsu Photonics KK	465.496	0,16
20.300	Hankyu Hanshin Holdings Inc	552.869	0,20
3.500	Harmonic Drive Systems Inc	101.892	0,04
22.800	Haseko Corp	266.676	0,09
1.600	Hikari Tsushin Inc	163.822	0,06
21.800	Hino Motors Ltd	111.844	0,04
2.700	Hirose Electric Co Ltd	357.933	0,13
5.000	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	128.630	0,05
8.800	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	194.649	0,07
81.000	Hitachi Ltd	3.838.490	1,36
15.800	Hitachi Metals Ltd	238.765	0,08
135.100	Honda Motor Co Ltd	3.274.700	1,16
8.400	Hoshizaki Corp	250.105	0,09
31.300	Hoya Corp	2.669.100	0,95
45.800	Hulic Co Ltd	353.980	0,13
10.367	Ibiden Co Ltd	291.883	0,10
17.640	Idemitsu Kosan Co Ltd	424.591	0,15
11.700	IHI Corp	312.620	0,11
13.300	Iida Group Holdings Co Ltd	204.510	0,07
85.300	Inpex Corp	922.977	0,33
26.700	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	216.186	0,08
50.100	Isuzu Motors Ltd	553.532	0,20

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
4.900	Ito En Ltd	219.293	0,08
124.100	ITOCHU Corp	3.349.709	1,19
7.400	Itochu Techno-Solutions Corp	181.112	0,06
18.500	J Front Retailing Co Ltd	157.963	0,06
36.300	Japan Airlines Co Ltd	634.592	0,22
44.300	Japan Exchange Group Inc	638.470	0,23
559	Japan Metropolitan Fund Invest (REIT)	434.922	0,15
31.098	Japan Post Bank Co Ltd	241.496	0,09
200.600	Japan Post Holdings Co Ltd	1.430.948	0,51
17.600	Japan Post Insurance Co Ltd	281.253	0,10
95.100	Japan Tobacco Inc	1.642.226	0,58
41.900	JFE Holdings Inc	441.036	0,16
19.500	JGC Holdings Corp	251.761	0,09
17.500	JSR Corp	453.425	0,16
19.700	JTEKT Corp	147.908	0,05
34.900	Kajima Corp	399.980	0,14
10.400	Kakaku.com Inc	171.324	0,06
63.400	Kansai Electric Power Co Inc/The	627.210	0,22
18.500	Kansai Paint Co Ltd	235.582	0,08
39.700	Kao Corp	1.599.046	0,57
13.100	Kawasaki Heavy Industries Ltd	245.309	0,09
4.536	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	275.455	0,10
126.600	KDDI Corp	3.996.816	1,42
8.600	Keihan Holdings Co Ltd	213.963	0,08
19.600	Keikyu Corp	214.532	0,08
8.900	Keio Corp	318.056	0,11
12.700	Keisei Electric Railway Co Ltd	349.623	0,12
6.100	Kewpie Corp	103.002	0,04

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
16.700	Keyence Corp	5.701.270	2,02
11.900	Kikkoman Corp	630.672	0,22
14.300	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	444.721	0,16
67.100	Kirin Holdings Co Ltd	1.055.730	0,37
4.000	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	246.145	0,09
11.644	Kobe Bussan Co Ltd	284.983	0,10
4.328	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	139.536	0,05
10.400	Koito Manufacturing Co Ltd	329.557	0,12
80.600	Komatsu Ltd	1.784.585	0,63
7.900	Konami Group Corp	436.708	0,15
2.800	Kose Corp	254.330	0,09
100.400	Kubota Corp	1.498.000	0,53
27.500	Kuraray Co Ltd	221.652	0,08
9.200	Kurita Water Industries Ltd	332.502	0,12
27.600	Kyocera Corp	1.474.113	0,52
20.500	Kyowa Kirin Co Ltd	460.233	0,16
38.300	Kyushu Electric Power Co Inc	245.833	0,09
11.100	Kyushu Railway Co	231.061	0,08
6.743	Lasertec Corp (Units)	801.586	0,28
3.400	Lawson Inc	113.121	0,04
19.700	Lion Corp	216.931	0,08
24.500	Lixil Corp	458.062	0,16
34.800	M3 Inc	998.494	0,35
20.400	Makita Corp	507.841	0,18
143.300	Marubeni Corp	1.291.077	0,46
15.900	Marui Group Co Ltd	277.962	0,10
10.129	MatsukiyoCocokara & Co	409.320	0,14
50.000	Mazda Motor Corp	408.524	0,14

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
7.000	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	254.536	0,09
85.000	Mebuki Financial Group Inc	167.053	0,06
15.500	Medipal Holdings Corp	218.373	0,08
9.800	MEIJI Holdings Co Ltd	480.424	0,17
8.900	Mercari Inc	127.747	0,05
32.200	MINEBEA MITSUMI Inc	547.510	0,19
24.100	MISUMI Group Inc	507.350	0,18
115.900	Mitsubishi Chemical Group Corp	628.746	0,22
115.800	Mitsubishi Corp	3.441.056	1,22
162.300	Mitsubishi Electric Corp	1.733.446	0,61
99.400	Mitsubishi Estate Co Ltd	1.440.643	0,51
16.300	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	234.563	0,08
62.900	Mitsubishi HC Capital Inc	289.834	0,10
26.700	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	932.549	0,33
9.900	Mitsubishi Materials Corp	141.517	0,05
58.294	Mitsubishi Motors Corp	196.952	0,07
970.100	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	5.208.428	1,85
131.200	Mitsui & Co Ltd	2.891.895	1,02
15.200	Mitsui Chemicals Inc	323.345	0,11
75.500	Mitsui Fudosan Co Ltd	1.621.370	0,57
30.500	Mitsui OSK Lines Ltd	697.085	0,25
7.494	Miura Co Ltd	147.944	0,05
199.560	Mizuho Financial Group Inc	2.266.542	0,80
20.700	MonotaRO Co Ltd	307.175	0,11
39.600	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	1.212.004	0,43
53.600	Murata Manufacturing Co Ltd	2.918.005	1,03
8.900	Nabtesco Corp	207.670	0,07
16.300	Nagoya Railroad Co Ltd	250.760	0,09

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
21.500	NEC Corp	834.014	0,30
37.800	Nexon Co Ltd	772.945	0,27
24.700	NGK Insulators Ltd	332.351	0,12
17.300	NGK Spark Plug Co Ltd	313.643	0,11
7.700	NH Foods Ltd	240.598	0,09
7.900	Nichirei Corp	137.176	0,05
42.300	Nidec Corp	2.609.208	0,92
26.800	Nihon M&A Center Holdings Inc	284.659	0,10
28.300	Nikon Corp	326.839	0,12
9.800	Nintendo Co Ltd	4.232.925	1,50
134	Nippon Building Fund Inc (REIT)	666.770	0,24
7.030	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	381.371	0,14
76.900	Nippon Paint Holdings Co Ltd	572.271	0,20
186	Nippon Prologis REIT Inc (REIT)	457.282	0,16
15.400	Nippon Sanso Holdings Corp	245.189	0,09
5.200	Nippon Shinyaku Co Ltd	315.778	0,11
73.700	Nippon Steel Corp	1.030.189	0,36
187.100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	5.365.586	1,90
8.600	Nippon Television Holdings Inc	76.406	0,03
14.200	Nippon Yusen KK	968.930	0,34
10.900	Nissan Chemical Corp	501.454	0,18
189.700	Nissan Motor Co Ltd	737.548	0,26
17.600	Nisshin Seifun Group Inc	205.725	0,07
5.200	Nissin Foods Holdings Co Ltd	358.647	0,13
6.900	Nitori Holdings Co Ltd	654.930	0,23
12.700	Nitto Denko Corp	820.772	0,29
255.800	Nomura Holdings Inc	933.725	0,33
9.600	Nomura Real Estate Holdings Inc	234.956	0,08

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
328	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	408.989	0,14
31.700	Nomura Research Institute Ltd	842.347	0,30
38.000	NSK Ltd	204.188	0,07
54.300	NTT Data Corp	749.820	0,27
51.100	Obayashi Corp	370.494	0,13
1.900	OBIC Business Consultants Co Ltd	65.242	0,02
5.400	Obic Co Ltd	762.769	0,27
28.200	Odakyu Electric Railway Co Ltd	378.823	0,13
72.900	Oji Holdings Corp	315.522	0,11
107.700	Olympus Corp	2.161.452	0,77
16.500	Omron Corp	836.933	0,30
33.000	Ono Pharmaceutical Co Ltd	845.799	0,30
7.005	Open House Group Co Ltd	278.437	0,10
2.500	Oracle Corp Japan	144.640	0,05
17.600	Oriental Land Co Ltd/Japan	2.451.084	0,87
103.200	ORIX Corp	1.728.926	0,61
216	Orix JREIT Inc (REIT)	292.865	0,10
34.500	Osaka Gas Co Ltd	659.247	0,23
9.200	Otsuka Corp	272.570	0,10
33.300	Otsuka Holdings Co Ltd	1.180.961	0,42
31.900	Pan Pacific International Holdings Corp	508.362	0,18
189.100	Panasonic Holdings Corp	1.526.246	0,54
9.700	Park24 Co Ltd	134.017	0,05
7.700	PeptiDream Inc	80.596	0,03
16.100	Persol Holdings Co Ltd	292.242	0,10
9.500	Pigeon Corp	130.135	0,05
6.100	Pola Orbis Holdings Inc	75.029	0,03
7.174	Rakus Co Ltd	84.437	0,03

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
73.300	Rakuten Group Inc	330.202	0,12
119.000	Recruit Holdings Co Ltd	3.499.356	1,24
98.700	Renesas Electronics Corp	895.787	0,32
200.500	Resona Holdings Inc	749.873	0,27
45.500	Ricoh Co Ltd	355.346	0,13
3.100	Rinnai Corp	212.896	0,08
7.300	Rohm Co Ltd	508.321	0,18
19.500	Ryohin Keikaku Co Ltd	198.509	0,07
29.800	Santen Pharmaceutical Co Ltd	233.390	0,08
21.200	SBI Holdings Inc/Japan	414.309	0,15
3.800	SCREEN Holdings Co Ltd	256.494	0,09
11.600	SCSK Corp	196.044	0,07
17.600	Secom Co Ltd	1.086.017	0,38
13.600	Sega Sammy Holdings Inc	218.032	0,08
19.000	Seibu Holdings Inc	199.713	0,07
24.200	Seiko Epson Corp	342.012	0,12
35.100	Sekisui Chemical Co Ltd	479.781	0,17
54.600	Sekisui House Ltd	955.113	0,34
63.800	Seven & i Holdings Co Ltd	2.473.480	0,88
28.800	Seven Bank Ltd	54.906	0,02
34.400	SG Holdings Co Ltd	579.600	0,21
25.600	Sharp Corp/Japan	197.670	0,07
24.200	Shimadzu Corp	764.182	0,27
2.000	Shimamura Co Ltd	175.334	0,06
6.800	Shimano Inc	1.147.223	0,41
44.200	Shimizu Corp	244.010	0,09
34.800	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	3.919.179	1,39
6.178	Shinko Electric Industries Co Ltd	159.162	0,06

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
6.200	Shinsei Bank Ltd	93.327	0,03
25.500	Shionogi & Co Ltd	1.286.684	0,46
33.900	Shiseido Co Ltd	1.358.945	0,48
39.200	Shizuoka Bank Ltd/The	235.163	0,08
15.400	Showa Denko KK	261.399	0,09
5.200	SMC Corp	2.314.556	0,82
228.500	SoftBank Corp	2.533.843	0,90
92.500	SoftBank Group Corp	3.564.370	1,26
5.700	Sohgo Security Services Co Ltd	158.176	0,06
19.040	Sojitz Corp	269.227	0,10
27.200	Sompo Holdings Inc	1.197.877	0,42
106.100	Sony Group Corp	8.664.970	3,07
7.500	Square Enix Holdings Co Ltd	331.788	0,12
12.300	Stanley Electric Co Ltd	201.718	0,07
51.500	Subaru Corp	914.153	0,32
2.339	Sugi Holdings Co Ltd	102.440	0,04
29.700	SUMCO Corp	384.545	0,14
135.200	Sumitomo Chemical Co Ltd	528.440	0,19
99.700	Sumitomo Corp	1.362.798	0,48
65.400	Sumitomo Electric Industries Ltd	721.612	0,26
9.100	Sumitomo Heavy Industries Ltd	200.615	0,07
20.800	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	650.694	0,23
102.700	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3.048.003	1,08
26.400	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	812.278	0,29
13.800	Sumitomo Pharma Co Ltd	110.823	0,04
26.800	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	706.815	0,25
14.600	Sumitomo Rubber Industries Ltd	124.555	0,04
4.200	Sundrug Co Ltd	93.673	0,03

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
11.100	Suntory Beverage & Food Ltd	419.145	0,15
5.600	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	158.080	0,06
34.800	Suzuki Motor Corp	1.092.247	0,39
13.100	Systemex Corp	787.418	0,28
44.900	T&D Holdings Inc	536.731	0,19
15.100	Taisei Corp	469.600	0,17
3.100	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	122.307	0,04
10.790	Taiyo Yuden Co Ltd	366.140	0,13
130.200	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	3.659.075	1,30
6.100	TBS Holdings Inc	76.286	0,03
32.800	TDK Corp	1.011.608	0,36
14.400	Teijin Ltd	149.771	0,05
61.400	Terumo Corp	1.847.582	0,65
9.900	THK Co Ltd	185.605	0,07
20.049	TIS Inc	524.634	0,19
14.500	Tobu Railway Co Ltd	330.334	0,12
491	Toei Animation Co Ltd	39.033	0,01
8.800	Toho Co Ltd/Tokyo	317.721	0,11
7.800	Toho Gas Co Ltd	188.031	0,07
38.100	Tohoku Electric Power Co Inc	203.884	0,07
52.900	Tokio Marine Holdings Inc	3.077.316	1,09
3.500	Tokyo Century Corp	115.675	0,04
12.800	Tokyo Electron Ltd	4.173.862	1,48
35.600	Tokyo Gas Co Ltd	735.558	0,26
45.400	Tokyu Corp	534.019	0,19
51.900	Tokyu Fudosan Holdings Corp	272.766	0,10
23.100	TOPPAN INC	385.468	0,14
126.400	Toray Industries Inc	708.223	0,25

## L&amp;G Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>			
24.500	Tosoh Corp	303.872	0,11
13.300	TOTO Ltd	438.585	0,16
7.200	Toyo Suisan Kaisha Ltd	280.358	0,10
6.300	Toyota Boshoku Corp	93.442	0,03
13.200	Toyota Industries Corp	816.164	0,29
933.800	Toyota Motor Corp	14.434.361	5,12
18.700	Toyota Tsusho Corp	609.775	0,22
10.900	Trend Micro Inc/Japan	531.140	0,19
3.000	Tsuruha Holdings Inc	162.747	0,06
33.800	Unicharm Corp	1.129.528	0,40
207	United Urban Investment Corp (REIT)	216.820	0,08
16.000	USS Co Ltd	276.648	0,10
6.900	Welcia Holdings Co Ltd	138.147	0,05
18.600	West Japan Railway Co	683.321	0,24
1.602	Workman Co Ltd	62.615	0,02
10.700	Yakult Honsha Co Ltd	616.694	0,22
58.600	Yamada Holdings Co Ltd	210.495	0,07
13.700	Yamaha Corp	564.720	0,20
26.500	Yamaha Motor Co Ltd	484.921	0,17
27.600	Yamato Holdings Co Ltd	440.852	0,16
9.900	Yamazaki Baking Co Ltd	120.749	0,04
21.000	Yaskawa Electric Corp	675.500	0,24
22.300	Yokogawa Electric Corp	367.850	0,13
11.400	Yokohama Rubber Co Ltd/The	154.148	0,05
223.400	Z Holdings Corp	651.840	0,23
9.300	ZOZO Inc	167.373	0,06
	<b>Japan insgesamt</b>	<b>280.471.821</b>	<b>99,40</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>280.471.821</b>	<b>99,40</b>

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	280.471.821	99,40
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.701.227	0,60
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>282.173.048</b>	<b>100,00</b>

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,39
Sonstige Vermögenswerte	0,61
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 2,11 %)</b>			
718	APA Group	5.565	0,01
1.242	Aristocrat Leisure Ltd	29.363	0,05
184	ASX Ltd	10.339	0,02
5.832	Aurizon Holdings Ltd	15.240	0,03
3.454	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	52.326	0,09
7.164	BHP Group Ltd	203.215	0,36
492	BlueScope Steel Ltd	5.379	0,01
2.791	Brambles Ltd	20.555	0,04
40	Cochlear Ltd	5.466	0,01
2.648	Coles Group Ltd	32.431	0,06
1.959	Commonwealth Bank of Australia	121.754	0,22
347	Computershare Ltd	5.880	0,01
631	CSL Ltd	116.750	0,21
717	Dexus (REIT)	4.378	0,01
1.178	Endeavour Group Ltd/Australia	6.132	0,01
2.300	Fortescue Metals Group Ltd	27.726	0,05
2.601	Goodman Group (REIT)	31.909	0,06
1.363	GPT Group/The (REIT)	3.955	0,01
5.076	Insurance Australia Group Ltd	15.219	0,03
404	Lendlease Corp Ltd	2.531	0,00
1.499	Lottery Corp Ltd/The	4.659	0,01
488	Macquarie Group Ltd	55.206	0,10
245	Mineral Resources Ltd	8.132	0,01
4.040	Mirvac Group (Units) (REIT)	5.487	0,01
4.445	National Australia Bank Ltd	83.722	0,15
1.414	Newcrest Mining Ltd	20.313	0,04
1.903	Northern Star Resources Ltd	8.951	0,01
968	Origin Energy Ltd	3.814	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 2,11 %) (Fortsetzung)</b>			
1.243	Qantas Airways Ltd	3.821	0,01
615	QBE Insurance Group Ltd	5.138	0,01
382	Ramsay Health Care Ltd	19.239	0,03
331	Rio Tinto Ltd	23.376	0,04
4.833	Santos Ltd	24.660	0,04
1.963	Scentre Group (REIT)	3.496	0,01
308	Sonic Healthcare Ltd	6.992	0,01
1.956	South32 Ltd	5.300	0,01
542	Suncorp Group Ltd	4.092	0,01
1.499	Tabcorp Holdings Ltd	1.098	0,00
18.752	Telstra Corp Ltd	49.646	0,09
5.252	Transurban Group	51.935	0,09
448	Treasury Wine Estates Ltd	3.497	0,01
10.966	Vicinity Centres (REIT)	13.838	0,02
956	Wesfarmers Ltd	27.552	0,05
4.424	Westpac Banking Corp	59.323	0,10
4.249	Woodside Energy Group Ltd	93.033	0,17
1.178	Woolworths Group Ltd	28.838	0,05
	<b>Australien insgesamt</b>	<b>1.331.271</b>	<b>2,38</b>
<b>Österreich (30. Juni 2021: 0,02 %)</b>			
165	Erste Group Bank AG	4.175	0,01
107	OMV AG	5.007	0,01
147	Verbund AG	14.346	0,02
	<b>Österreich insgesamt</b>	<b>23.528</b>	<b>0,04</b>
<b>Belgien (30. Juni 2021: 0,28 %)</b>			
362	Ageas SA/NV	15.887	0,03
962	Anheuser-Busch InBev SA/NV	51.654	0,09
269	Etablissements Franz Colruyt NV	7.298	0,01
209	Groupe Bruxelles Lambert SA	17.410	0,03

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Belgien (30. Juni 2021: 0,28 %) (Fortsetzung)</b>			
314	KBC Group NV	17.576	0,03
43	Solvay SA	3.476	0,00
168	Telenet Group Holding NV	3.479	0,01
60	UCB SA	5.058	0,01
104	Umicore SA	3.623	0,01
	<b>Belgien insgesamt</b>	<b>125.461</b>	<b>0,22</b>
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 0,20 %)</b>			
6.000	Alibaba Health Information Technology Ltd	4.129	0,01
431	Arch Capital Group Ltd	19.606	0,03
1.600	China Gas Holdings Ltd	2.471	0,00
25	Everest Re Group Ltd	7.007	0,01
38	HAL Trust	4.879	0,01
800	Hongkong Land Holdings Ltd	4.016	0,01
700	Jardine Matheson Holdings Ltd	36.792	0,07
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>78.900</b>	<b>0,14</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 3,57 %)</b>			
484	Agnico Eagle Mines Ltd (Units)	22.107	0,04
400	Air Canada	4.974	0,01
1.300	Algonquin Power & Utilities Corp	17.435	0,03
800	Alimentation Couche-Tard Inc	31.139	0,06
421	Atco Ltd/Canada	14.393	0,03
3.072	B2Gold Corp	10.383	0,02
723	Bank of Montreal	69.376	0,12
1.384	Bank of Nova Scotia/The	81.733	0,15
2.592	Barrick Gold Corp	45.733	0,08
600	BCE Inc	29.429	0,05
1.492	Brookfield Asset Management Inc - Class A	66.228	0,12
549	CAE Inc	13.500	0,02
510	Cameco Corp	10.698	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Kanada (30. Juni 2021: 3,57 %) (Fortsetzung)</b>			
501	Canadian Apartment Properties REIT (Units) (REIT)	17.407	0,03
1.026	Canadian Imperial Bank of Commerce	49.719	0,09
799	Canadian National Railway Co	89.682	0,16
995	Canadian Pacific Railway Ltd	69.351	0,12
97	Canadian Tire Corp Ltd	12.212	0,02
744	Canadian Utilities Ltd	22.142	0,04
100	CCL Industries Inc - Class B	4.716	0,01
100	CGI Inc	7.949	0,01
1.099	Choice Properties Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	11.970	0,02
29	Constellation Software Inc/Canada	42.959	0,08
200	Dollarama Inc	11.492	0,02
208	Emera Inc	9.723	0,02
1.900	Enbridge Inc	80.067	0,14
57	Fairfax Financial Holdings Ltd	30.140	0,05
796	First Quantum Minerals Ltd	15.069	0,03
202	Fortis Inc/Canada	9.529	0,02
232	Franco-Nevada Corp	30.452	0,05
82	George Weston Ltd	9.559	0,02
200	Gildan Activewear Inc	5.744	0,01
200	Great-West Lifeco Inc	4.873	0,01
1.218	Hydro One Ltd '144A'	32.679	0,06
225	Intact Financial Corp	31.668	0,06
500	Keyera Corp	11.396	0,02
1.500	Kinross Gold Corp	5.326	0,01
154	Lightspeed Commerce Inc	3.426	0,01
435	Loblaw Cos Ltd	39.148	0,07
300	Magna International Inc (Units)	16.438	0,03
2.745	Manulife Financial Corp	47.496	0,08
200	Metro Inc/CN	10.712	0,02
300	National Bank of Canada	19.645	0,03
844	Nutrien Ltd	67.070	0,12

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Kanada (30. Juni 2021: 3,57 %) (Fortsetzung)</b>			
56	Nuvei Corp '144A'	2.019	0,00
100	Onex Corp	4.969	0,01
200	Open Text Corp	7.549	0,01
500	Pembina Pipeline Corp	17.636	0,03
390	Power Corp of Canada	10.013	0,02
427	Restaurant Brands International Inc	21.374	0,04
1.000	RioCan Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	15.520	0,03
229	Ritchie Bros Auctioneers Inc	14.868	0,03
300	Rogers Communications Inc	14.345	0,03
1.532	Royal Bank of Canada	148.026	0,26
200	Saputo Inc	4.352	0,01
300	Shaw Communications Inc	8.821	0,02
1.210	Shopify Inc - Class A	37.727	0,07
600	Sun Life Financial Inc	27.433	0,05
1.431	TC Energy Corp	73.970	0,13
828	Teck Resources Ltd	25.264	0,04
1.036	TELUS Corp	23.025	0,04
99	TFI International Inc	7.930	0,01
90	Thomson Reuters Corp	9.362	0,02
1.800	Toronto-Dominion Bank/The	117.784	0,21
370	Tourmaline Oil Corp	19.197	0,03
200	Waste Connections Inc	24.745	0,04
199	West Fraser Timber Co Ltd (Units)	15.237	0,03
302	Wheaton Precious Metals Corp	10.858	0,02
205	WSP Global Inc	23.129	0,04
	<b>Kanada insgesamt</b>	<b>1.922.040</b>	<b>3,43</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,24 %)</b>			
3.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	14.968	0,03
2.000	CK Asset Holdings Ltd	14.146	0,02
2.500	CK Hutchison Holdings Ltd	16.901	0,03
402	Farfetch Ltd	2.878	0,00

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,24 %) (Fortsetzung)</b>			
7.448	Geely Automobile Holdings Ltd	16.933	0,03
6.081	Grab Holdings Ltd	15.385	0,03
3.000	JS Global Lifestyle Co Ltd '144A'	3.907	0,01
1.200	Sands China Ltd	2.863	0,00
490	Sea Ltd ADR	32.761	0,06
7.500	Sino Biopharmaceutical Ltd	4.750	0,01
7.000	WH Group Ltd '144A'	5.406	0,01
3.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	14.299	0,03
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>145.197</b>	<b>0,26</b>
<b>Curaçao (30. Juni 2021: 0,06 %)</b>			
1.614	Schlumberger NV	57.717	0,10
<b>Curacao insgesamt</b>		<b>57.717</b>	<b>0,10</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 0,73 %)</b>			
9	AP Moller - Maersk A/S - Class B	20.946	0,04
192	Carlsberg AS	24.400	0,04
48	Chr Hansen Holding A/S	3.486	0,01
149	Coloplast A/S	16.933	0,03
273	Danske Bank A/S	3.849	0,01
264	Demant A/S	9.883	0,02
262	DSV A/S	36.508	0,06
70	Genmab A/S	22.604	0,04
252	GN Store Nord AS	8.811	0,02
1.873	Novo Nordisk A/S	207.276	0,37
101	Novozymes A/S	6.049	0,01
180	Orsted AS '144A'	18.774	0,03
133	Pandora A/S	8.348	0,01
1.009	Tryg A/S	22.603	0,04
1.320	Vestas Wind Systems A/S	27.817	0,05
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>438.287</b>	<b>0,78</b>

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Finnland (30. Juni 2021: 0,38 %)</b>			
116	Elisa Oyj	6.503	0,01
231	Fortum Oyj	3.457	0,01
729	Kesko Oyj	17.156	0,03
550	Kone Oyj - Class B	26.082	0,05
697	Neste Oyj	30.779	0,06
5.344	Nokia Oyj	24.803	0,04
4.898	Nordea Bank Abp	42.993	0,08
390	Sampo Oyj - Class A	16.929	0,03
1.175	Stora Enso Oyj	18.383	0,03
538	UPM-Kymmene Oyj	16.317	0,03
282	Wartsila OYJ Abp	2.190	0,00
	<b>Finnland insgesamt</b>	<b>205.592</b>	<b>0,37</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 2,79 %)</b>			
24	Aeroports de Paris	3.032	0,00
616	Air Liquide SA	82.509	0,15
120	Amundi SA '144A'	6.549	0,01
2.523	AXA SA	57.132	0,10
1.425	BNP Paribas SA	67.583	0,12
2.517	Bolloré SE	11.631	0,02
132	Bouygues SA	4.052	0,01
145	Capgemini SE	24.777	0,04
252	Carrefour SA	4.448	0,01
725	Cie de Saint-Gobain	31.034	0,05
532	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	14.447	0,03
516	Credit Agricole SA	4.710	0,01
803	Danone SA	44.712	0,08
515	Dassault Systemes SE	18.906	0,03
5.184	Electricite de France SA	42.306	0,08
1.375	Engie SA	15.764	0,03
342	EssilorLuxottica SA	51.093	0,09
54	Euroapi SA	850	0,00

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 2,79 %) (Fortsetzung)</b>			
40	Hermes International	44.620	0,08
80	Kering SA	40.990	0,07
369	Legrand SA	27.181	0,05
415	L'Oreal SA	142.871	0,25
385	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	234.134	0,42
2.681	Orange SA	31.448	0,06
136	Pernod Ricard SA	24.924	0,04
490	Safran SA	48.261	0,09
1.255	Sanofi	126.402	0,23
22	Sartorius Stedim Biotech	6.884	0,01
554	Schneider Electric SE	65.390	0,12
657	Societe Generale SA	14.349	0,03
51	Sodexo SA	3.576	0,01
91	Teleperformance	27.903	0,05
171	Thales SA	20.925	0,04
2.748	TotalEnergies SE	144.708	0,26
594	Vinci SA	52.760	0,09
840	Vivendi SE	8.515	0,01
366	Worldline SA/France '144A'	13.538	0,02
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>1.564.914</b>	<b>2,79</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 2,59 %)</b>			
175	adidas AG	30.875	0,06
396	Allianz SE	75.397	0,13
1.058	BASF SE	45.930	0,08
1.223	Bayer AG	72.521	0,13
448	Bayerische Motoren Werke AG	34.406	0,06
48	Beiersdorf AG	4.892	0,01
89	BioNTech SE ADR	13.264	0,02
42	Continental AG	2.920	0,01
75	Covestro AG '144A'	2.586	0,00
448	Daimler Truck Holding AG	11.667	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 2,59 %) (Fortsetzung)</b>			
108	Delivery Hero SE '144A'	4.039	0,01
2.854	Deutsche Bank AG	24.819	0,04
143	Deutsche Boerse AG	23.860	0,04
794	Deutsche Post AG	29.667	0,05
3.543	Deutsche Telekom AG	70.177	0,13
1.972	E.ON SE	16.510	0,03
568	Evonik Industries AG	12.090	0,02
294	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	14.640	0,03
614	Fresenius SE & Co KGaA	18.551	0,03
37	Hannover Rueck SE	5.357	0,01
31	Hapag-Lloyd AG '144A'	8.005	0,01
73	HeidelbergCement AG	3.498	0,01
169	Henkel AG & Co KGaA	10.318	0,02
1.370	Infineon Technologies AG	33.071	0,06
190	Knorr-Bremse AG	10.810	0,02
896	Mercedes-Benz Group AG	51.726	0,09
167	Merck KGaA	28.109	0,05
85	MTU Aero Engines AG	15.436	0,03
118	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	27.658	0,05
1.232	SAP SE	111.966	0,20
1.035	Siemens AG	105.056	0,19
654	Siemens Energy AG	9.562	0,02
368	Siemens Healthineers AG '144A'	18.655	0,03
209	Symrise AG - Class A	22.691	0,04
514	Talanx AG	19.517	0,03
3.883	Telefonica Deutschland Holding AG	11.123	0,02
688	Vonovia SE	21.147	0,04
167	Zalando SE '144A'	4.358	0,01
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>1.026.874</b>	<b>1,83</b>

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Guernsey (30. Juni 2021: 0,01 %)</b>			
79	Amdocs Ltd	6.581	0,01
<b>Guernsey insgesamt</b>		<b>6.581</b>	<b>0,01</b>
<b>Hongkong (30. Juni 2021: 0,76 %)</b>			
15.600	AIA Group Ltd	169.082	0,30
1.600	Bank of East Asia Ltd/The	2.251	0,00
6.000	China Evergrande New Energy Vehicle Group Ltd*	–	–
11.520	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	11.436	0,02
7.000	Fosun International Ltd	6.468	0,01
1.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	5.964	0,01
7.000	Hang Lung Properties Ltd	13.274	0,02
300	Hang Seng Bank Ltd	5.295	0,01
2.200	Henderson Land Development Co Ltd	8.243	0,02
7.276	Hong Kong & China Gas Co Ltd	7.835	0,01
1.200	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	59.029	0,11
2.500	Link REIT (Units) (REIT)	20.390	0,04
1.019	MTR Corp Ltd	5.324	0,01
1.000	New World Development Co Ltd	3.587	0,01
1.000	Power Assets Holdings Ltd	6.289	0,01
8.000	Sino Land Co Ltd	11.806	0,02
1.500	Sun Hung Kai Properties Ltd	17.720	0,03
500	Swire Pacific Ltd	2.979	0,01
1.500	Techtronic Industries Co Ltd	15.646	0,03
2.000	Wharf Holdings Ltd/The	7.290	0,01
<b>Hongkong insgesamt</b>		<b>379.908</b>	<b>0,68</b>
<b>International (30. Juni 2021: – %)</b>			
5.651	HKT Trust & HKT Ltd	7.590	0,01
<b>International insgesamt</b>		<b>7.590</b>	<b>0,01</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 1,68 %)</b>			
942	Accenture Plc - Class A	261.546	0,47

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland (30. Juni 2021: 1,68 %) (Fortsetzung)</b>			
213	Aon Plc	57.442	0,10
723	CRH Plc	24.943	0,04
59	DCC Plc	3.653	0,01
473	Eaton Corp Plc	59.593	0,11
204	Flutter Entertainment Plc	20.577	0,04
216	Horizon Therapeutics Plc	17.228	0,03
93	ICON Plc	20.153	0,04
535	James Hardie Industries Plc CDI	11.688	0,02
31	Jazz Pharmaceuticals Plc	4.836	0,01
706	Johnson Controls International plc	33.803	0,06
136	Kerry Group Plc	12.987	0,02
112	Kingspan Group Plc	6.721	0,01
579	Linde Plc	166.480	0,30
1.574	Medtronic Plc	141.267	0,25
1.395	Ryanair Holdings Plc	16.444	0,03
266	Seagate Technology Holdings Plc	19.003	0,03
154	Smurfit Kappa Group Plc	5.165	0,01
318	STERIS Plc	65.556	0,12
235	Trane Technologies Plc	30.519	0,05
135	Willis Towers Watson Plc	26.648	0,05
	<b>Irland insgesamt</b>	<b>1.006.252</b>	<b>1,80</b>
<b>Isle of Man (30. Juni 2021: 0,04 %)</b>			
831	Entain Plc	12.565	0,02
	<b>Isle of Man insgesamt</b>	<b>12.565</b>	<b>0,02</b>
<b>Israel (30. Juni 2021: 0,35 %)</b>			
43	Airport City Ltd	732	0,00
795	Alony Hetz Properties & Investments Ltd	9.934	0,02
1.805	Amot Investments Ltd	10.813	0,02
129	Azrieli Group Ltd	9.002	0,02
733	Bank Hapoalim BM	6.103	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Israel (30. Juni 2021: 0,35 %) (Fortsetzung)</b>			
901	Bank Leumi Le-Israel BM	7.988	0,01
33	Big Shopping Centers Ltd	4.051	0,01
53	Check Point Software Technologies Ltd	6.454	0,01
2.340	Energix-Renewable Energies Ltd	7.062	0,01
165	First International Bank Of Israel Ltd/The	6.129	0,01
1.144	ICL Group Ltd	10.352	0,02
7	Israel Corp Ltd	3.068	0,00
56	Kornit Digital Ltd	1.775	0,00
380	Matrix IT Ltd	8.786	0,02
48	Nice Ltd	9.190	0,02
338	Sapiens International Corp NV	7.914	0,01
2.298	Shikun & Binui Ltd	9.331	0,02
741	Shufersal Ltd	4.845	0,01
20	Strauss Group Ltd	490	0,00
1.205	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	9.187	0,02
89	Wix.com Ltd	5.834	0,01
	<b>Israel insgesamt</b>	<b>139.040</b>	<b>0,25</b>
<b>Italien (30. Juni 2021: 0,67 %)</b>			
4.627	A2A SpA	5.863	0,01
257	Amplifon SpA	7.859	0,02
1.349	Assicurazioni Generali SpA	21.472	0,04
248	Atlantia SpA	5.803	0,01
700	Banca Mediolanum SpA	4.594	0,01
454	Buzzi Unicem SpA	7.409	0,01
9.274	Enel SpA	50.611	0,09
1.911	Eni SpA	22.632	0,04
1.553	FinecoBank Banca Fineco SpA	18.541	0,03
3.767	Hera SpA	10.869	0,02
25.610	Intesa Sanpaolo SpA	47.658	0,09
559	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	4.826	0,01
137	Moncler SpA	5.862	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Italien (30. Juni 2021: 0,67 %) (Fortsetzung)</b>			
1.559	Nexi SpA '144A'	12.882	0,02
2.877	Pirelli & C SpA '144A'	11.658	0,02
739	Prysmian SpA	20.250	0,04
1.184	Snam SpA	6.188	0,01
15.256	Telecom Italia SpA/Milano	3.799	0,01
8.192	Telecom Italia SpA/Milano	2.139	0,00
955	Terna - Rete Elettrica Nazionale	7.476	0,01
2.006	UniCredit SpA	19.011	0,03
<b>Italien insgesamt</b>		<b>297.402</b>	<b>0,53</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 7,44 %)</b>			
200	Advantest Corp	10.688	0,02
1.700	Aeon Co Ltd	29.456	0,05
200	AGC Inc	7.022	0,01
100	Aisin Corp	3.092	0,00
300	Ajinomoto Co Inc	7.287	0,01
900	ANA Holdings Inc	16.558	0,03
800	Asahi Group Holdings Ltd	26.175	0,05
400	Asahi Intecc Co Ltd	6.030	0,01
500	Asahi Kasei Corp	3.813	0,01
1.800	Astellas Pharma Inc	28.022	0,05
100	Bandai Namco Holdings Inc	7.051	0,01
953	Bridgestone Corp	34.723	0,06
800	Brother Industries Ltd	14.044	0,02
900	Canon Inc	20.437	0,04
200	Central Japan Railway Co	23.047	0,04
1.800	Chubu Electric Power Co Inc	18.099	0,03
1.000	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	25.542	0,05
700	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	8.347	0,01
1.100	Concordia Financial Group Ltd	3.806	0,01
400	CyberAgent Inc	3.978	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 7,44 %) (Fortsetzung)</b>			
200	Dai Nippon Printing Co Ltd	4.308	0,01
100	Daifuku Co Ltd	5.712	0,01
1.800	Dai-ichi Life Holdings Inc	33.256	0,06
2.000	Daiichi Sankyo Co Ltd	50.598	0,09
300	Daikin Industries Ltd	48.029	0,09
100	Daito Trust Construction Co Ltd	8.619	0,01
300	Daiwa House Industry Co Ltd	6.982	0,01
6	Daiwa House REIT Investment Corp (REIT)	13.581	0,02
900	Daiwa Securities Group Inc	4.015	0,01
600	Denso Corp	31.834	0,06
100	Dentsu Group Inc	2.999	0,00
900	East Japan Railway Co	45.962	0,08
300	Eisai Co Ltd	12.642	0,02
1.400	ENEOS Holdings Inc	5.294	0,01
200	FANUC Corp	31.269	0,06
79	Fast Retailing Co Ltd	41.333	0,07
500	FUJIFILM Holdings Corp	26.786	0,05
200	Fujitsu Ltd	24.975	0,04
10	GLP J-Reit (REIT)	12.197	0,02
1.500	Hakuhodo DY Holdings Inc	13.746	0,02
200	Hankyu Hanshin Holdings Inc	5.447	0,01
1.300	Hitachi Ltd	61.605	0,11
300	Hitachi Metals Ltd	4.533	0,01
2.200	Honda Motor Co Ltd	53.326	0,09
400	Hoya Corp	34.110	0,06
600	Idemitsu Kosan Co Ltd	14.442	0,03
1.900	Inpex Corp	20.559	0,04
400	Isuzu Motors Ltd	4.419	0,01
2.300	ITOCHE Corp	62.082	0,11
700	Itochu Techno-Solutions Corp	17.132	0,03
1.472	J Front Retailing Co Ltd	12.569	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 7,44 %) (Fortsetzung)</b>			
500	Japan Airlines Co Ltd	8.741	0,02
1.000	Japan Exchange Group Inc	14.412	0,03
6	Japan Metropolitan Fund Invest (REIT)	4.668	0,01
6.900	Japan Post Holdings Co Ltd	49.220	0,09
1.400	Japan Tobacco Inc	24.176	0,04
300	JFE Holdings Inc	3.158	0,01
400	Kajima Corp	4.584	0,01
1.400	Kansai Electric Power Co Inc/The	13.850	0,02
400	Kao Corp	16.111	0,03
500	Kawasaki Heavy Industries Ltd	9.363	0,02
2.000	KDDI Corp	63.141	0,11
600	Keikyu Corp	6.567	0,01
100	Keio Corp	3.574	0,01
500	Keisei Electric Railway Co Ltd	13.765	0,02
199	Keyence Corp	67.937	0,12
100	Kikkoman Corp	5.300	0,01
100	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	3.110	0,01
400	Kirin Holdings Co Ltd	6.293	0,01
300	Kobe Bussan Co Ltd	7.342	0,01
100	Koito Manufacturing Co Ltd	3.169	0,01
900	Komatsu Ltd	19.927	0,04
1.800	Kubota Corp	26.857	0,05
400	Kuraray Co Ltd	3.224	0,01
300	Kyocera Corp	16.023	0,03
800	Kyowa Kirin Co Ltd	17.960	0,03
2.400	Kyushu Electric Power Co Inc	15.405	0,03
300	Kyushu Railway Co	6.245	0,01
100	Lasertec Corp (Units)	11.888	0,02
300	Lawson Inc	9.981	0,02
400	Lion Corp	4.405	0,01
300	M3 Inc	8.608	0,01
400	Makita Corp	9.958	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 7,44 %) (Fortsetzung)</b>			
3.100	Marubeni Corp	27.930	0,05
1.800	Mazda Motor Corp	14.707	0,03
100	MEIJI Holdings Co Ltd	4.902	0,01
300	MINEBEA MITSUMI Inc	5.101	0,01
200	MISUMI Group Inc	4.210	0,01
600	Mitsubishi Chemical Group Corp	3.255	0,01
1.971	Mitsubishi Corp	58.569	0,10
1.600	Mitsubishi Electric Corp	17.089	0,03
600	Mitsubishi Estate Co Ltd	8.696	0,01
1.200	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	41.912	0,07
14.400	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	77.313	0,14
2.413	Mitsui & Co Ltd	53.187	0,09
1.000	Mitsui Fudosan Co Ltd	21.475	0,04
600	Mitsui OSK Lines Ltd	13.713	0,02
2.860	Mizuho Financial Group Inc	32.483	0,06
500	MonotaRO Co Ltd	7.420	0,01
200	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	6.121	0,01
900	Murata Manufacturing Co Ltd	48.996	0,09
700	Nagoya Railroad Co Ltd	10.769	0,02
200	NEC Corp	7.758	0,01
400	Nexon Co Ltd	8.179	0,01
700	Nidec Corp	43.178	0,08
600	Nihon M&A Center Holdings Inc	6.373	0,01
300	Nikon Corp	3.465	0,01
100	Nintendo Co Ltd	43.193	0,08
4	Nippon Building Fund Inc (REIT)	19.904	0,04
231	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	12.531	0,02
1.000	Nippon Paint Holdings Co Ltd	7.442	0,01
400	Nippon Steel Corp	5.591	0,01
2.800	Nippon Telegraph & Telephone Corp	80.297	0,14
400	Nippon Yusen KK	27.294	0,05
100	Nissan Chemical Corp	4.600	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 7,44 %) (Fortsetzung)</b>			
3.500	Nissan Motor Co Ltd	13.608	0,02
900	Nisshin Seifun Group Inc	10.520	0,02
100	Nitori Holdings Co Ltd	9.492	0,02
100	Nitto Denko Corp	6.463	0,01
1.500	Nomura Holdings Inc	5.475	0,01
4	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	4.988	0,01
300	Nomura Research Institute Ltd	7.972	0,01
400	NTT Data Corp	5.524	0,01
500	Obayashi Corp	3.625	0,01
100	Obic Co Ltd	14.125	0,02
200	Odakyu Electric Railway Co Ltd	2.687	0,00
800	Oji Holdings Corp	3.462	0,01
1.800	Olympus Corp	36.125	0,06
100	Omron Corp	5.072	0,01
200	Ono Pharmaceutical Co Ltd	5.126	0,01
300	Oriental Land Co Ltd/Japan	41.780	0,07
1.400	ORIX Corp	23.454	0,04
300	Osaka Gas Co Ltd	5.733	0,01
400	Otsuka Corp	11.851	0,02
800	Otsuka Holdings Co Ltd	28.371	0,05
400	Pan Pacific International Holdings Corp	6.374	0,01
2.500	Panasonic Holdings Corp	20.178	0,04
200	PeptiDream Inc	2.093	0,00
100	Pigeon Corp	1.370	0,00
700	Rakuten Group Inc	3.153	0,01
1.600	Recruit Holdings Co Ltd	47.050	0,08
1.200	Renesas Electronics Corp	10.891	0,02
1.000	Resona Holdings Inc	3.740	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 7,44 %) (Fortsetzung)</b>			
500	Ricoh Co Ltd	3.905	0,01
100	Rohm Co Ltd	6.963	0,01
300	Santen Pharmaceutical Co Ltd	2.350	0,00
200	SBI Holdings Inc/Japan	3.909	0,01
200	SCREEN Holdings Co Ltd	13.500	0,02
300	SCSK Corp	5.070	0,01
100	Secom Co Ltd	6.171	0,01
600	Seibu Holdings Inc	6.307	0,01
300	Sekisui Chemical Co Ltd	4.101	0,01
300	Sekisui House Ltd	5.248	0,01
1.100	Seven & i Holdings Co Ltd	42.646	0,08
1.000	SG Holdings Co Ltd	16.849	0,03
200	Shimadzu Corp	6.316	0,01
100	Shimano Inc	16.871	0,03
500	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	56.310	0,10
200	Shionogi & Co Ltd	10.092	0,02
400	Shiseido Co Ltd	16.035	0,03
100	Showa Denko KK	1.697	0,00
100	SMC Corp	44.511	0,08
3.600	SoftBank Corp	39.920	0,07
1.200	SoftBank Group Corp	46.240	0,08
280	Sojitz Corp	3.959	0,01
200	Sompo Holdings Inc	8.808	0,02
1.395	Sony Group Corp	113.927	0,20
200	Square Enix Holdings Co Ltd	8.848	0,02
300	Subaru Corp	5.325	0,01
200	Sugi Holdings Co Ltd	8.759	0,02
1.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	3.909	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 7,44 %) (Fortsetzung)</b>			
1.300	Sumitomo Corp	17.770	0,03
400	Sumitomo Electric Industries Ltd	4.414	0,01
200	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	6.257	0,01
1.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	29.679	0,05
200	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	6.154	0,01
600	Sumitomo Pharma Co Ltd	4.818	0,01
200	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	5.275	0,01
1.525	Sumitomo Rubber Industries Ltd	13.010	0,02
300	Sundrug Co Ltd	6.691	0,01
100	Suntory Beverage & Food Ltd	3.776	0,01
200	Suzuki Motor Corp	6.277	0,01
100	Systemex Corp	6.011	0,01
300	T&D Holdings Inc	3.586	0,01
100	Taisei Corp	3.110	0,01
300	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	11.836	0,02
1.400	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	39.345	0,07
300	TDK Corp	9.252	0,02
600	Terumo Corp	18.055	0,03
200	Tobu Railway Co Ltd	4.556	0,01
100	Toho Gas Co Ltd	2.411	0,00
2.300	Tohoku Electric Power Co Inc	12.308	0,02
600	Tokio Marine Holdings Inc	34.903	0,06
200	Tokyo Electron Ltd	65.217	0,12
200	Tokyo Gas Co Ltd	4.132	0,01
300	Tokyu Corp	3.529	0,01
8.200	Toray Industries Inc	45.945	0,08
100	TOTO Ltd	3.298	0,01
1.001	Toyota Boshoku Corp	14.847	0,03

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 7,44 %) (Fortsetzung)</b>			
100	Toyota Industries Corp	6.183	0,01
16.300	Toyota Motor Corp	251.960	0,45
100	Toyota Tsusho Corp	3.261	0,01
100	Trend Micro Inc/Japan	4.873	0,01
700	Unicharm Corp	23.393	0,04
500	USS Co Ltd	8.645	0,01
800	West Japan Railway Co	29.390	0,05
100	Yakult Honsha Co Ltd	5.763	0,01
100	Yamaha Corp	4.122	0,01
300	Yamaha Motor Co Ltd	5.490	0,01
200	Yamato Holdings Co Ltd	3.195	0,01
200	Yaskawa Electric Corp	6.433	0,01
1.700	Z Holdings Corp	4.960	0,01
	<b>Japan insgesamt</b>	<b>3.811.171</b>	<b>6,80</b>
<b>Jersey (30. Juni 2021: 0,34 %)</b>			
1.784	Amtcor Plc	22.175	0,04
281	Aptiv Plc	25.029	0,04
863	Experian Plc	25.216	0,04
178	Ferguson Plc	19.862	0,04
13.299	Glencore Plc	71.888	0,13
1.782	WPP Plc	17.846	0,03
	<b>Jersey insgesamt</b>	<b>182.016</b>	<b>0,32</b>
<b>Liberia (30. Juni 2021: 0,02 %)</b>			
144	Royal Caribbean Cruises Ltd	5.027	0,01
	<b>Liberia insgesamt</b>	<b>5.027</b>	<b>0,01</b>

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 0,17 %)</b>			
653	ArcelorMittal SA	14.684	0,03
163	Eurofins Scientific SE	12.794	0,02
564	InPost SA	3.262	0,01
88	Millicom International Cellular SA SDR	1.254	0,00
149	Spotify Technology SA	13.981	0,02
326	Tenaris SA	4.182	0,01
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>50.157</b>	<b>0,09</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 1,63 %)</b>			
758	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A'	8.491	0,02
26	Adyen NV '144A'	37.728	0,07
102	AerCap Holdings NV	4.176	0,01
595	Airbus SE	57.508	0,10
86	Akzo Nobel NV	5.630	0,01
139	Argenx SE ADR	52.664	0,09
64	ASM International NV	15.964	0,03
463	ASML Holding NV	220.652	0,39
474	CNH Industrial NV	5.461	0,01
86	EXOR NV	5.348	0,01
118	Ferrari NV	21.613	0,04
57	Heineken Holding NV	4.139	0,01
245	Heineken NV	22.284	0,04
4.371	ING Groep NV	43.097	0,08
233	JDE Peet's NV	6.616	0,01
790	Koninklijke Ahold Delhaize NV	20.532	0,04
254	Koninklijke DSM NV	36.406	0,06
1.850	Koninklijke KPN NV	6.578	0,01
1.226	Koninklijke Philips NV	26.346	0,05
253	LyondellBasell Industries NV	22.127	0,04
131	NN Group NV	5.936	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 1,63 %) (Fortsetzung)</b>			
314	NXP Semiconductors NV	46.481	0,08
1.019	Prosus NV	66.561	0,12
102	Randstad NV	4.927	0,01
2.235	Stellantis NV	27.553	0,05
2.205	STMicroelectronics NV	69.122	0,12
2.312	Universal Music Group NV	46.248	0,08
417	Wolters Kluwer NV	40.352	0,07
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>930.540</b>	<b>1,66</b>
<b>Neuseeland (30. Juni 2021: 0,18 %)</b>			
802	a2 Milk Co Ltd/The	2.458	0,00
1.041	Auckland International Airport Ltd	4.647	0,01
3.121	Chorus Ltd	14.010	0,03
546	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	6.783	0,01
4.457	Fletcher Building Ltd	13.966	0,02
2.145	Infratil Ltd	10.242	0,02
199	Mainfreight Ltd	8.649	0,02
1.884	Spark New Zealand Ltd	5.623	0,01
280	Xero Ltd	14.818	0,03
<b>Neuseeland insgesamt</b>		<b>81.196</b>	<b>0,15</b>
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 0,20 %)</b>			
1.440	DNB Bank ASA	25.733	0,05
1.298	Equinor ASA	45.004	0,08
202	Mowi ASA	4.582	0,01
4.519	NEL ASA	5.473	0,01
2.330	Norsk Hydro ASA	13.009	0,02
587	Orkla ASA	4.677	0,01
374	Schibsted ASA	6.659	0,01
151	Schibsted ASA - Class B	2.453	0,00
1.489	Storebrand ASA	10.565	0,02
296	Telenor ASA	3.925	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 0,20 %) (Fortsetzung)</b>			
600	TOMRA Systems ASA	11.094	0,02
113	Yara International ASA	4.707	0,01
<b>Norwegen insgesamt</b>		<b>137.881</b>	<b>0,25</b>
<b>Panama (30. Juni 2021: 0,05 %)</b>			
965	Carnival Corp	8.347	0,02
<b>Panama insgesamt</b>		<b>8.347</b>	<b>0,02</b>
<b>Polen (30. Juni 2021: 0,08 %)</b>			
1.956	Cyfrowy Polsat SA	9.232	0,01
73	mBank SA	3.647	0,01
182	Santander Bank Polska SA	9.432	0,02
<b>Polen insgesamt</b>		<b>22.311</b>	<b>0,04</b>
<b>Portugal (30. Juni 2021: 0,02 %)</b>			
1.417	EDP - Energias de Portugal SA	6.595	0,01
292	Galp Energia SGPS SA	3.415	0,01
<b>Portugal insgesamt</b>		<b>10.010</b>	<b>0,02</b>
<b>Singapur (30. Juni 2021: 0,32 %)</b>			
12.040	CapitaLand Integrated Commercial Trust (Units) (REIT)	18.773	0,03
9.887	Capitaland Investment Ltd/Singapore	27.138	0,05
693	CDL Hospitality Trusts	632	0,00
4.363	City Developments Ltd	25.550	0,05
2.100	DBS Group Holdings Ltd	44.786	0,08
1.100	Keppel Corp Ltd	5.130	0,01
11.645	Mapletree Commercial Trust (REIT)	15.313	0,03
4.753	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	38.900	0,07
2.900	Singapore Exchange Ltd	19.713	0,03
3.700	Singapore Telecommunications Ltd	6.726	0,01
1.500	United Overseas Bank Ltd	28.293	0,05
1.200	UOL Group Ltd	6.346	0,01
<b>Singapur insgesamt</b>		<b>237.300</b>	<b>0,42</b>

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien (30. Juni 2021: 0,71 %)</b>			
136	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	3.289	0,00
32	Aena SME SA '144A'	4.056	0,01
605	Amadeus IT Group SA	33.624	0,06
7.349	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	33.271	0,06
17.744	Banco Santander SA	49.864	0,09
7.119	CaixaBank SA	24.687	0,04
671	Cellnex Telecom SA '144A'	25.976	0,05
235	Endesa SA	4.422	0,01
667	Ferrovial SA	16.868	0,03
194	Grifols SA	3.658	0,01
6.905	Iberdrola SA	71.438	0,13
1.210	Industria de Diseno Textil SA	27.311	0,05
5.518	International Consolidated Airlines Group SA	7.212	0,01
5.351	Mapfre SA	9.409	0,02
569	Naturgy Energy Group SA	16.341	0,03
240	Red Electrica Corp SA	4.523	0,01
1.264	Repsol SA	18.566	0,03
393	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	7.359	0,01
3.948	Telefonica SA	20.068	0,03
	<b>Spanien insgesamt</b>	<b>381.942</b>	<b>0,68</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 1,23 %)</b>			
200	Alfa Laval AB	4.813	0,01
1.124	Assa Abloy AB	23.835	0,04
2.464	Atlas Copco AB	22.980	0,04
848	Atlas Copco AB	7.079	0,01
762	Axfood AB	21.884	0,04
436	Boliden AB	13.843	0,02
231	Electrolux AB	3.103	0,01
603	Epiroc AB	8.132	0,01
431	EQT AB	8.807	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (30. Juni 2021: 1,23 %)</b>			
1.030	Essity AB	26.847	0,05
234	Evolution AB '144A'	21.239	0,04
1.554	Fastighets AB Balder - Class B	7.432	0,01
322	H & M Hennes & Mauritz AB	3.839	0,01
2.794	Hexagon AB	28.970	0,05
1.117	Industrivarden AB	24.798	0,04
222	Industrivarden AB - Class A	4.987	0,01
705	Indutrade AB	12.834	0,02
608	Investor AB	9.979	0,02
2.667	Investor AB	47.797	0,09
188	Kinnevik AB	3.023	0,01
2.978	Nibe Industrier AB	22.319	0,04
623	Sagax AB	11.472	0,02
1.316	Sandvik AB	21.299	0,04
553	Sinch AB '144A'	1.797	0,00
701	Skandinaviska Enskilda Banken AB - Class A	6.868	0,01
315	Skanska AB	4.820	0,01
307	SKF AB	4.509	0,01
3.039	SSAB AB	13.247	0,02
542	Svenska Cellulosa AB SCA - Class B	8.082	0,01
581	Svenska Handelsbanken AB - Class A	4.957	0,01
2.697	Svenska Handelsbanken AB - Class B	26.477	0,05
845	Swedbank AB	10.662	0,02
4.664	Swedish Match AB	47.426	0,08
2.390	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	17.788	0,03
1.076	Telia Co AB	4.114	0,01
2.503	Volvo AB	38.685	0,07
	<b>Schweden insgesamt</b>	<b>550.743</b>	<b>0,98</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 2,74 %)</b>			
1.614	ABB Ltd	42.923	0,08
524	Alcon Inc	36.497	0,06
438	Chubb Ltd	86.102	0,15

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 2,74 %) (Fortsetzung)</b>			
434	Cie Financiere Richemont SA	46.082	0,08
2.225	Credit Suisse Group AG	12.597	0,02
162	Garmin Ltd	15.916	0,03
54	Geberit AG	25.879	0,05
7	Givaudan SA	24.546	0,04
848	Holcim AG	36.184	0,06
37	Kuehne + Nagel International AG	8.734	0,02
69	Lonza Group AG	36.686	0,07
3.215	Nestle SA	374.242	0,67
3.057	Novartis AG	258.170	0,46
25	Partners Group Holding AG	22.463	0,04
881	Roche Holding AG	293.146	0,52
60	Roche Holding AG	23.089	0,04
37	Schindler Holding AG	6.632	0,01
25	Schindler Holding AG	4.546	0,01
2	SGS SA	4.565	0,01
141	Sika AG	32.402	0,06
150	Straumann Holding AG	17.964	0,03
15	Swatch Group AG/The	3.549	0,01
447	Swatch Group AG/The	19.816	0,03
276	Swiss Re AG	21.328	0,04
11	Swisscom AG	6.060	0,01
444	TE Connectivity Ltd	50.239	0,09
4.371	UBS Group AG	70.267	0,13
150	Zurich Insurance Group AG	65.055	0,12
	<b>Schweiz insgesamt</b>	<b>1.645.679</b>	<b>2,94</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 4,41 %)</b>			
446	3i Group Plc	6.004	0,01
1.420	abrdn plc	2.757	0,00
471	Admiral Group Plc	12.836	0,02
1.415	Anglo American Plc	50.471	0,09

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 4,41 %) (Fortsetzung)</b>			
1.332	Antofagasta Plc	18.684	0,03
654	Ashtead Group Plc	27.314	0,05
161	Associated British Foods Plc	3.085	0,00
1.750	AstraZeneca Plc	229.531	0,41
142	Atlassian Corp Plc	26.611	0,05
1.775	Auto Trader Group Plc '144A'	11.964	0,02
2.702	Aviva Plc	13.168	0,02
4.300	BAE Systems Plc	43.354	0,08
24.030	Barclays Plc	44.685	0,08
715	Barratt Developments Plc	3.972	0,01
138	Berkeley Group Holdings Plc	6.241	0,01
18.914	BP Plc	89.193	0,16
2.546	British American Tobacco Plc	108.823	0,19
637	British Land Co Plc/The (REIT)	3.459	0,01
6.391	BT Group Plc	14.460	0,03
171	Bunzl Plc	5.647	0,01
213	Burberry Group Plc	4.245	0,01
90	Carnival Plc	677	0,00
108	Coca-Cola Europacific Partners Plc	5.574	0,01
2.166	Compass Group Plc	44.192	0,08
78	Croda International Plc	6.131	0,01
656	Darktrace Plc	2.347	0,00
4.074	Diageo Plc	174.677	0,31
4.112	Direct Line Insurance Group Plc	12.569	0,02
577	easyJet Plc	2.569	0,00
5.580	GlaxoSmithKline Plc	119.648	0,21
647	Halma Plc	15.786	0,03
541	Hargreaves Lansdown Plc	5.176	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 4,41 %) (Fortsetzung)</b>			
22.161	HSBC Holdings Plc	144.148	0,26
1.150	Imperial Brands Plc	25.642	0,05
545	Informa Plc	3.500	0,01
89	InterContinental Hotels Group Plc	4.702	0,01
630	Intermediate Capital Group Plc	10.015	0,02
82	Intertek Group Plc	4.189	0,01
2.481	ITV Plc	1.966	0,00
1.226	J Sainsbury Plc	3.037	0,00
15.935	JD Sports Fashion Plc	22.333	0,04
128	Johnson Matthey Plc	2.993	0,00
1.509	Kingfisher Plc	4.477	0,01
448	Land Securities Group Plc (REIT)	3.613	0,01
5.418	Legal & General Group Plc	15.759	0,03
264	Liberty Global Plc	5.832	0,01
82.240	Lloyds Banking Group Plc	42.258	0,07
455	London Stock Exchange Group Plc	42.172	0,07
1.854	M&G Plc	4.382	0,01
1.565	Meggitt Plc	14.996	0,03
2.009	Melrose Industries Plc	3.652	0,01
673	Mondi Plc	11.892	0,02
3.931	National Grid Plc	50.223	0,09
7.203	NatWest Group Plc	19.096	0,03
73	Next Plc	5.195	0,01
159	NMC Health Plc*	–	–
512	Ocado Group Plc	4.857	0,01
1.210	Pearson Plc	11.018	0,02
162	Persimmon Plc	3.665	0,01
4.015	Phoenix Group Holdings Plc	28.788	0,05

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 4,41 %) (Fortsetzung)</b>			
3.131	Prudential Plc	38.633	0,07
885	Reckitt Benckiser Group Plc	66.314	0,12
2.487	RELX Plc	67.233	0,12
1.251	Rentokil Initial Plc	7.210	0,01
2.231	Rightmove Plc	15.400	0,03
1.150	Rio Tinto Plc	68.665	0,12
6.965	Rolls-Royce Holdings Plc	7.016	0,01
522	Royalty Pharma Plc - Class A	21.945	0,04
692	Sage Group Plc/The	5.335	0,01
146	Schroders Plc	4.738	0,01
624	Segro Plc (REIT)	7.402	0,01
473	Severn Trent Plc	15.619	0,03
8.638	Shell Plc	223.866	0,40
1.466	Smith & Nephew Plc	20.430	0,04
285	Smiths Group Plc	4.844	0,01
82	Spirax-Sarco Engineering Plc	9.837	0,02
1.064	SSE Plc	20.882	0,04
378	St James's Place Plc	5.061	0,01
2.903	Standard Chartered Plc	21.809	0,04
2.325	Taylor Wimpey Plc	3.294	0,01
10.586	Tesco Plc	32.847	0,06
3.973	Unilever Plc	179.539	0,32
517	United Utilities Group Plc	6.404	0,01
36.293	Vodafone Group Plc	55.827	0,10
554	Weir Group Plc/The	9.170	0,02
94	Whitbread Plc	2.829	0,00
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>2.532.399</b>	<b>4,52</b>

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %)</b>			
593	3M Co	76.740	0,14
303	A O Smith Corp	16.568	0,03
1.950	Abbott Laboratories	211.868	0,38
1.983	AbbVie Inc	303.716	0,54
44	ABIOMED Inc	10.890	0,02
893	Activision Blizzard Inc	69.529	0,12
587	Adobe Inc	214.877	0,38
30	Advance Auto Parts Inc	5.193	0,01
1.990	Advanced Micro Devices Inc	152.175	0,27
174	Affirm Holdings Inc	3.142	0,01
489	Aflac Inc	27.056	0,05
274	Agilent Technologies Inc	32.543	0,06
248	Air Products & Chemicals Inc	59.639	0,11
329	Airbnb Inc	29.307	0,05
190	Akamai Technologies Inc	17.353	0,03
126	Albemarle Corp	26.331	0,05
183	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	26.540	0,05
81	Align Technology Inc	19.170	0,03
8	Alleghany Corp	6.665	0,01
323	Alliant Energy Corp	18.931	0,03
367	Allstate Corp/The	46.510	0,08
196	Ally Financial Inc	6.568	0,01
123	Alnylam Pharmaceuticals Inc	17.940	0,03
323	Alphabet Inc	706.546	1,26
357	Alphabet Inc - Class A	777.996	1,39
2.094	Altria Group Inc	87.466	0,16
10.400	Amazon.com Inc	1.104.584	1,97
267	Ameren Corp	24.126	0,04
650	American Express Co	90.103	0,16
1.161	American International Group Inc	59.362	0,11
512	American Tower Corp (REIT)	130.862	0,23

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
289	American Water Works Co Inc	42.995	0,08
155	Ameriprise Financial Inc	36.840	0,07
235	AmerisourceBergen Corp - Class A	33.248	0,06
220	AMETEK Inc	24.176	0,04
634	Amgen Inc	154.252	0,28
882	Amphenol Corp - Class A	56.783	0,10
623	Analog Devices Inc	91.014	0,16
4.539	Annaly Capital Management Inc (REIT)	26.825	0,05
95	ANSYS Inc	22.733	0,04
1.043	Apollo Global Management Inc	50.565	0,09
19.149	Apple Inc	2.618.051	4,67
1.046	Applied Materials Inc	95.165	0,17
96	AppLovin Corp - Class A	3.306	0,01
628	Archer-Daniels-Midland Co	48.733	0,09
228	Arista Networks Inc	21.373	0,04
193	Arthur J Gallagher & Co	31.467	0,06
9.097	AT&T Inc	190.673	0,34
207	Atmos Energy Corp	23.205	0,04
227	Autodesk Inc	39.035	0,07
478	Automatic Data Processing Inc	100.399	0,18
20	AutoZone Inc	42.982	0,08
110	AvalonBay Communities Inc (REIT)	21.368	0,04
245	Avangrid Inc	11.299	0,02
508	Avantor Inc	15.799	0,03
1.345	Baker Hughes Co - Class A	38.830	0,07
424	Ball Corp	29.158	0,05
8.066	Bank of America Corp	251.095	0,45
780	Bank of New York Mellon Corp/The	32.534	0,06
610	Baxter International Inc	39.180	0,07
336	Becton Dickinson and Co	82.834	0,15

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
1.509	Berkshire Hathaway Inc - Class B	411.987	0,74
291	Best Buy Co Inc	18.970	0,03
100	Bill.com Holdings Inc	10.994	0,02
141	Biogen Inc	28.756	0,05
282	BioMarin Pharmaceutical Inc	23.369	0,04
155	BlackRock Inc	94.401	0,17
795	Blackstone Inc	72.528	0,13
576	Block Inc	35.401	0,06
730	Boeing Co/The	99.806	0,18
44	Booking Holdings Inc	76.956	0,14
154	Boston Properties Inc (REIT)	13.703	0,02
1.519	Boston Scientific Corp	56.613	0,10
2.620	Bristol-Myers Squibb Co	201.740	0,36
434	Broadcom Inc	210.842	0,38
90	Broadridge Financial Solutions Inc	12.830	0,02
210	Brown-Forman Corp	14.204	0,03
162	Brown-Forman Corp	11.366	0,02
88	Burlington Stores Inc	11.988	0,02
350	Cadence Design Systems Inc	52.511	0,09
271	Caesars Entertainment Inc	10.379	0,02
133	Campbell Soup Co	6.391	0,01
400	Capital One Financial Corp	41.676	0,07
381	Cardinal Health Inc	19.915	0,04
153	CarMax Inc	13.843	0,02
1.067	Carrier Global Corp	38.049	0,07
84	Carvana Co - Class A	1.897	0,00
188	Catalent Inc	20.171	0,04
735	Caterpillar Inc	131.389	0,23
106	Cboe Global Markets Inc	11.998	0,02
460	CBRE Group Inc - Class A	33.861	0,06
159	CDW Corp/DE	25.052	0,04
145	Celanese Corp - Class A	17.053	0,03

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
602	Centene Corp	50.935	0,09
751	CenterPoint Energy Inc	22.215	0,04
167	CH Robinson Worldwide Inc	16.929	0,03
2.156	Charles Schwab Corp/The	136.216	0,24
121	Charter Communications Inc	56.692	0,10
342	Cheniere Energy Inc	45.496	0,08
2.304	Chevron Corp	333.573	0,60
31	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	40.525	0,07
308	Church & Dwight Co Inc	28.539	0,05
358	Cigna Corp	94.340	0,17
157	Cincinnati Financial Corp	18.680	0,03
104	Cintas Corp	38.847	0,07
4.682	Cisco Systems Inc	199.640	0,36
2.178	Citigroup Inc	100.166	0,18
413	Citizens Financial Group Inc	14.740	0,03
153	Citrix Systems Inc	14.867	0,03
133	Clorox Co/The	18.750	0,03
247	Cloudflare Inc	10.806	0,02
380	CME Group Inc	77.786	0,14
476	CMS Energy Corp	32.130	0,06
4.530	Coca-Cola Co/The	284.982	0,51
553	Cognizant Technology Solutions Corp	37.322	0,07
143	Coinbase Global Inc	6.724	0,01
946	Colgate-Palmolive Co	75.812	0,14
5.025	Comcast Corp	197.181	0,35
505	Conagra Brands Inc	17.291	0,03
1.612	ConocoPhillips	144.774	0,26
268	Consolidated Edison Inc	25.487	0,05
177	Constellation Brands Inc - Class A	41.252	0,07
300	Constellation Energy Corp	17.178	0,03
60	Cooper Cos Inc/The	18.787	0,03
217	Copart Inc	23.579	0,04

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
617	Corning Inc	19.442	0,03
873	Corteva Inc	47.264	0,08
577	CoStar Group Inc	34.857	0,06
506	Costco Wholesale Corp	242.516	0,43
822	Coupang Inc	10.481	0,02
220	CrowdStrike Holdings Inc	37.083	0,07
492	Crown Castle International Corp (REIT)	82.843	0,15
2.376	CSX Corp	69.047	0,12
141	Cummins Inc	27.288	0,05
1.442	CVS Health Corp	133.616	0,24
718	Danaher Corp	182.027	0,33
146	Darden Restaurants Inc	16.516	0,03
298	Datadog Inc	28.382	0,05
73	DaVita Inc	5.837	0,01
303	Deere & Co	90.739	0,16
204	Dell Technologies Inc	9.427	0,02
505	Delta Air Lines Inc	14.630	0,03
143	DENTSPLY SIRONA Inc	5.109	0,01
927	Devon Energy Corp	51.087	0,09
380	Dexcom Inc	28.321	0,05
344	Diamondback Energy Inc	41.676	0,07
344	Digital Realty Trust Inc (REIT)	44.662	0,08
325	Discover Financial Services	30.739	0,06
161	DISH Network Corp - Class A	2.887	0,01
198	DocuSign Inc - Class A	11.361	0,02
285	Dollar General Corp	69.950	0,13
239	Dollar Tree Inc	37.248	0,07
1.038	Dominion Energy Inc	82.843	0,15
46	Domino's Pizza Inc	17.927	0,03
176	DoorDash Inc	11.294	0,02
173	Dover Corp	20.988	0,04
867	Dow Inc	44.746	0,08

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
452	DR Horton Inc	29.918	0,05
296	DTE Energy Co	37.518	0,07
765	Duke Energy Corp	82.016	0,15
777	Duke Realty Corp (REIT)	42.696	0,08
590	DuPont de Nemours Inc	32.792	0,06
147	Eastman Chemical Co	13.196	0,02
730	eBay Inc	30.419	0,05
266	Ecolab Inc	40.900	0,07
442	Edison International	27.952	0,05
790	Edwards Lifesciences Corp	75.121	0,13
516	Elanco Animal Health Inc	10.129	0,02
298	Electronic Arts Inc	36.252	0,06
261	Elevance Health Inc	125.953	0,22
987	Eli Lilly & Co	320.015	0,57
593	Emerson Electric Co	47.167	0,08
194	Enphase Energy Inc	37.877	0,07
352	Entergy Corp	39.649	0,07
681	EOG Resources Inc	75.210	0,13
60	EPAM Systems Inc	17.687	0,03
145	Equifax Inc	26.503	0,05
143	Equinix Inc (REIT)	93.954	0,17
289	Equity Residential (REIT)	20.872	0,04
46	Essex Property Trust Inc (REIT)	12.029	0,02
212	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	53.990	0,10
164	Etsy Inc	12.006	0,02
398	Eversource Energy	33.619	0,06
237	Exact Sciences Corp	9.335	0,02
903	Exelon Corp	40.924	0,07
202	Expedia Group Inc	19.156	0,03
179	Expeditors International of Washington Inc	17.445	0,03
116	Extra Space Storage Inc (REIT)	19.734	0,04
5.053	Exxon Mobil Corp	432.739	0,77

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
28	F5 Inc	4.285	0,01
490	Fastenal Co	24.461	0,04
261	FedEx Corp	59.171	0,11
152	Fidelity National Financial Inc	5.618	0,01
617	Fidelity National Information Services Inc	56.560	0,10
1.121	Fifth Third Bancorp	37.666	0,07
239	First Republic Bank/CA	34.464	0,06
481	FirstEnergy Corp	18.466	0,03
618	Fiserv Inc	54.983	0,10
92	FleetCor Technologies Inc	19.330	0,03
182	FMC Corp	19.476	0,03
4.270	Ford Motor Co	47.525	0,08
875	Fortinet Inc	49.508	0,09
366	Fortive Corp	19.903	0,04
230	Fortune Brands Home & Security Inc	13.772	0,02
140	Fox Corp	4.502	0,01
255	Fox Corp	7.574	0,01
162	Franklin Resources Inc	3.776	0,01
1.791	Freeport-McMoRan Inc	52.405	0,09
84	Gartner Inc	20.314	0,04
72	Generac Holdings Inc	15.162	0,03
257	General Dynamics Corp	56.861	0,10
1.239	General Electric Co	78.887	0,14
785	General Mills Inc	59.228	0,11
1.409	General Motors Co	44.750	0,08
119	Genuine Parts Co	15.827	0,03
1.414	Gilead Sciences Inc	87.399	0,16
317	Global Payments Inc	35.073	0,06
58	Globe Life Inc	5.653	0,01
551	Goldman Sachs Group Inc/The	163.658	0,29
1.537	Halliburton Co	48.200	0,09
560	Hartford Financial Services Group Inc/The	36.641	0,07

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
153	Hasbro Inc	12.528	0,02
269	HCA Healthcare Inc	45.208	0,08
602	Healthpeak Properties Inc (REIT)	15.598	0,03
203	Henry Schein Inc	15.578	0,03
185	Hershey Co/The	39.805	0,07
417	Hess Corp	44.177	0,08
1.207	Hewlett Packard Enterprise Co	16.005	0,03
298	Hilton Worldwide Holdings Inc	33.209	0,06
275	Hologic Inc	19.058	0,03
1.299	Home Depot Inc/The	356.277	0,64
785	Honeywell International Inc	136.441	0,24
304	Hormel Foods Corp	14.397	0,03
1.541	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	24.163	0,04
1.221	HP Inc	40.024	0,07
49	HubSpot Inc	14.732	0,03
136	Humana Inc	63.658	0,11
1.783	Huntington Bancshares Inc/OH	21.449	0,04
65	IAC/InterActiveCorp	4.938	0,01
90	IDEXX Laboratories Inc	31.566	0,06
327	Illinois Tool Works Inc	59.596	0,11
173	Illumina Inc	31.894	0,06
263	Incyte Corp	19.980	0,04
489	Ingersoll Rand Inc	20.577	0,04
4.578	Intel Corp	171.263	0,31
142	Interactive Brokers Group Inc	7.811	0,01
563	Intercontinental Exchange Inc	52.945	0,09
1.003	International Business Machines Corp	141.614	0,25
329	International Flavors & Fragrances Inc	39.190	0,07
359	International Paper Co	15.017	0,03
402	Intuit Inc	154.947	0,28

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
377	Intuitive Surgical Inc	75.668	0,14
606	Invitation Homes Inc (REIT)	21.561	0,04
257	IQVIA Holdings Inc	55.766	0,10
158	Iron Mountain Inc (REIT)	7.693	0,01
122	J M Smucker Co/The	15.617	0,03
46	JB Hunt Transport Services Inc	7.244	0,01
2.972	Johnson & Johnson	527.560	0,94
3.834	JPMorgan Chase & Co	431.747	0,77
313	Kellogg Co	22.329	0,04
825	Keurig Dr Pepper Inc	29.197	0,05
1.082	KeyCorp	18.643	0,03
187	Keysight Technologies Inc	25.778	0,05
364	Kimberly-Clark Corp	49.195	0,09
2.150	Kinder Morgan Inc	36.034	0,06
677	KKR & Co Inc	31.338	0,06
183	KLA Corp	58.392	0,10
886	Kraft Heinz Co/The	33.792	0,06
785	Kroger Co/The	37.154	0,07
208	L3Harris Technologies Inc	50.274	0,09
148	Laboratory Corp of America Holdings	34.685	0,06
170	Lam Research Corp	72.446	0,13
321	Las Vegas Sands Corp	10.782	0,02
194	Leidos Holdings Inc	19.538	0,04
370	Lennar Corp	21.723	0,04
28	Lennar Corp	1.976	0,00
60	Liberty Broadband Corp	6.938	0,01
109	Liberty Broadband Corp	12.377	0,02
187	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	6.739	0,01
123	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	4.434	0,01
216	Live Nation Entertainment Inc	17.837	0,03
180	LKQ Corp	8.836	0,02
372	Lockheed Martin Corp	159.945	0,29

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
103	Loews Corp	6.104	0,01
785	Lowe's Cos Inc	137.116	0,24
596	Lucid Group Inc	10.227	0,02
126	Lululemon Athletica Inc	34.349	0,06
1.099	Lumen Technologies Inc	11.990	0,02
186	Lyft Inc	2.470	0,00
401	M&T Bank Corp	63.915	0,11
668	Marathon Petroleum Corp	54.916	0,10
13	Markel Corp	16.812	0,03
350	Marriott International Inc/MD	47.604	0,09
520	Marsh & McLennan Cos Inc	80.730	0,14
61	Martin Marietta Materials Inc	18.254	0,03
992	Marvell Technology Inc	43.182	0,08
159	Masco Corp	8.045	0,01
1.059	Mastercard Inc	334.093	0,60
325	Match Group Inc	22.649	0,04
328	McCormick & Co Inc/MD	27.306	0,05
828	McDonald's Corp	204.417	0,37
149	McKesson Corp	48.605	0,09
57	MercadoLibre Inc	36.302	0,06
2.926	Merck & Co Inc	266.763	0,48
2.705	Meta Platforms Inc - Class A	436.181	0,78
703	MetLife Inc	44.141	0,08
26	Mettler-Toledo International Inc	29.868	0,05
572	MGM Resorts International	16.559	0,03
583	Microchip Technology Inc	33.861	0,06
1.226	Micron Technology Inc	67.773	0,12
8.623	Microsoft Corp	2.214.645	3,95
145	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	25.327	0,05
411	Moderna Inc	58.711	0,10
79	Molson Coors Beverage Co - Class B	4.306	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
1.697	Mondelez International Inc	105.367	0,19
68	MongoDB Inc - Class A	17.646	0,03
353	Monster Beverage Corp	32.723	0,06
198	Moody's Corp	53.850	0,10
1.481	Morgan Stanley	112.645	0,20
586	Mosaic Co/The	27.677	0,05
187	Motorola Solutions Inc	39.195	0,07
94	MSCI Inc - Class A	38.742	0,07
87	Nasdaq Inc	13.271	0,02
318	NetApp Inc	20.746	0,04
550	Netflix Inc	96.178	0,17
250	Newell Brands Inc	4.760	0,01
831	Newmont Corp	49.586	0,09
2.231	NextEra Energy Inc	172.813	0,31
1.599	NIKE Inc	163.418	0,29
193	NiSource Inc	5.692	0,01
260	Norfolk Southern Corp	59.095	0,11
196	Northern Trust Corp	18.910	0,03
154	Northrop Grumman Corp	73.700	0,13
566	NortonLifeLock Inc	12.429	0,02
296	Nucor Corp	30.905	0,06
3.331	NVIDIA Corp	504.946	0,90
4	NVR Inc	16.017	0,03
1.114	Occidental Petroleum Corp	65.592	0,12
137	Okta Inc	12.385	0,02
128	Old Dominion Freight Line Inc	32.804	0,06
224	Omnicom Group Inc	14.249	0,03
368	ONEOK Inc	20.424	0,04
1.859	Oracle Corp	129.888	0,23
108	O'Reilly Automotive Inc	68.230	0,12
217	Organon & Co	7.324	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
448	Otis Worldwide Corp	31.660	0,06
452	PACCAR Inc	37.218	0,07
52	Packaging Corp of America	7.150	0,01
1.500	Palantir Technologies Inc	13.605	0,02
136	Palo Alto Networks Inc	67.176	0,12
760	Paramount Global - Class B	18.757	0,03
132	Parker-Hannifin Corp	32.479	0,06
325	Paychex Inc	37.008	0,07
58	Paycom Software Inc	16.247	0,03
1.412	PayPal Holdings Inc	98.614	0,18
1.558	PepsiCo Inc	259.656	0,46
6.504	Pfizer Inc	341.005	0,61
1.891	Philip Morris International Inc	186.717	0,33
481	Phillips 66	39.437	0,07
60	Pinnacle West Capital Corp	4.387	0,01
476	Pinterest Inc	8.644	0,02
306	Pioneer Natural Resources Co	68.262	0,12
488	PNC Financial Services Group Inc/The	76.992	0,14
264	PPG Industries Inc	30.186	0,05
569	PPL Corp	15.437	0,03
282	Principal Financial Group Inc	18.835	0,03
2.715	Procter & Gamble Co/The	390.390	0,70
651	Progressive Corp/The	75.692	0,14
770	Prologis Inc (REIT)	90.591	0,16
547	Prudential Financial Inc	52.337	0,09
364	Public Service Enterprise Group Inc	23.034	0,04
146	Public Storage (REIT)	45.650	0,08
202	PulteGroup Inc	8.005	0,01
72	Qorvo Inc	6.791	0,01
1.277	QUALCOMM Inc	163.124	0,29
140	Quest Diagnostics Inc	18.617	0,03
649	Raymond James Financial Inc	58.027	0,10

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
1.605	Raytheon Technologies Corp	154.257	0,28
1.506	Realty Income Corp (REIT)	102.800	0,18
112	Regeneron Pharmaceuticals Inc	66.207	0,12
1.244	Regions Financial Corp	23.325	0,04
198	Republic Services Inc - Class A	25.912	0,05
180	ResMed Inc	37.733	0,07
77	RingCentral Inc - Class A	4.024	0,01
366	Rivian Automotive Inc	9.421	0,02
315	ROBLOX Corp	10.351	0,02
125	Rockwell Automation Inc	24.914	0,04
100	Roku Inc	8.214	0,01
535	Rollins Inc	18.682	0,03
114	Roper Technologies Inc	44.990	0,08
409	Ross Stores Inc	28.724	0,05
449	S&P Global Inc	151.340	0,27
1.189	Salesforce Inc	196.233	0,35
142	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	45.447	0,08
139	Seagen Inc	24.595	0,04
445	Sempra Energy	66.870	0,12
240	ServiceNow Inc	114.125	0,20
252	Sherwin-Williams Co/The	56.425	0,10
363	Simon Property Group Inc (REIT)	34.456	0,06
818	Sirius XM Holdings Inc	5.014	0,01
164	Skyworks Solutions Inc	15.193	0,03
1.280	Snap Inc	16.806	0,03
32	Snap-on Inc	6.305	0,01
326	Snowflake Inc	45.334	0,08
1.103	Southern Co/The (Units)	78.655	0,14
760	Southwest Airlines Co	27.451	0,05
160	Splunk Inc	14.154	0,03
344	SS&C Technologies Holdings Inc	19.976	0,04
186	Stanley Black & Decker Inc	19.504	0,03

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
1.455	Starbucks Corp	111.147	0,20
421	State Street Corp	25.955	0,05
411	Stryker Corp	81.760	0,15
63	SVB Financial Group	24.884	0,04
647	Synchrony Financial	17.870	0,03
201	Synopsys Inc	61.044	0,11
537	Sysco Corp	45.489	0,08
222	T Rowe Price Group Inc	25.221	0,05
155	Take-Two Interactive Software Inc	18.992	0,03
501	Target Corp	70.756	0,13
173	Teladoc Health Inc	5.745	0,01
75	Teleflex Inc	18.439	0,03
186	Teradyne Inc	16.656	0,03
977	Tesla Inc	657.931	1,17
968	Texas Instruments Inc	148.733	0,27
226	Textron Inc	13.802	0,02
438	Thermo Fisher Scientific Inc	237.957	0,42
1.213	TJX Cos Inc/The	67.746	0,12
926	T-Mobile US Inc	124.584	0,22
145	Tractor Supply Co	28.108	0,05
400	Trade Desk Inc/The - Class A	16.756	0,03
49	TransDigm Group Inc	26.297	0,05
223	TransUnion	17.838	0,03
308	Travelers Cos Inc/The	52.092	0,09
284	Trimble Inc	16.537	0,03
1.349	Truist Financial Corp	63.983	0,11
181	Twilio Inc - Class A	15.170	0,03
747	Twitter Inc	27.930	0,05
241	Tyson Foods Inc - Class A	20.740	0,04
1.856	Uber Technologies Inc	37.974	0,07
126	UDR Inc (REIT)	5.801	0,01
250	UiPath Inc	4.548	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
59	Ulta Beauty Inc	22.743	0,04
719	Union Pacific Corp	153.348	0,27
218	United Airlines Holdings Inc	7.722	0,01
807	United Parcel Service Inc - Class B	147.310	0,26
69	United Rentals Inc	16.761	0,03
1.116	UnitedHealth Group Inc	573.211	1,02
229	Unity Software Inc	8.432	0,02
40	Universal Health Services Inc	4.028	0,01
1.381	US Bancorp	63.554	0,11
20	Vail Resorts Inc	4.361	0,01
459	Valero Energy Corp	48.783	0,09
139	Veeva Systems Inc - Class A	27.528	0,05
514	Ventas Inc (REIT)	26.435	0,05
150	VeriSign Inc	25.100	0,04
167	Verisk Analytics Inc - Class A	28.906	0,05
4.969	Verizon Communications Inc	252.177	0,45
295	Vertex Pharmaceuticals Inc	83.128	0,15
407	VF Corp	17.977	0,03
1.150	Viatris Inc	12.041	0,02
1.959	Visa Inc - Class A	385.708	0,69
225	VMware Inc	25.646	0,05
206	Vulcan Materials Co	29.273	0,05
145	W R Berkley Corp	9.898	0,02
740	Walgreens Boots Alliance Inc	28.046	0,05
1.625	Walmart Inc	197.568	0,35
2.104	Walt Disney Co/The	198.618	0,35
2.713	Warner Bros Discovery Inc	36.408	0,07
430	Waste Management Inc	65.781	0,12
61	Waters Corp	20.190	0,04
97	Wayfair Inc	4.225	0,01
252	WEC Energy Group Inc	25.361	0,05
432	Welltower Inc (REIT)	35.575	0,06

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,71 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 63,69 %) (Fortsetzung)</b>			
101	West Pharmaceutical Services Inc	30.539	0,05
255	Western Digital Corp	11.432	0,02
227	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	18.632	0,03
460	Westrock Co	18.326	0,03
651	Weyerhaeuser Co (REIT)	21.561	0,04
43	Whirlpool Corp	6.659	0,01
1.198	Williams Cos Inc/The	37.390	0,07
223	Workday Inc - Class A	31.126	0,06
207	WP Carey Inc (REIT)	17.152	0,03
41	WW Grainger Inc	18.632	0,03
622	Xcel Energy Inc	44.013	0,08
238	Xylem Inc/NY	18.607	0,03
624	Yum China Holdings Inc	30.264	0,05
268	Yum! Brands Inc	30.421	0,05
57	Zebra Technologies Corp	16.755	0,03
210	Zillow Group Inc	6.668	0,01
176	Zimmer Biomet Holdings Inc	18.491	0,03
533	Zoetis Inc	91.617	0,16
217	Zoom Video Communications Inc - Class A	23.429	0,04
236	ZoomInfo Technologies Inc - Class A	7.845	0,01
89	Zscaler Inc	13.306	0,02
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>36.449.467</b>	<b>65,06</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>55.805.305</b>	<b>99,60</b>
<b>Vorzugsaktien (3. Juni 2021: – %)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: – %)</b>			
45	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	3.180	0,01
222	Henkel AG & Co KGaA - Preference	13.642	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Vorzugsaktien (3. Juni 2021: – %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: – %) (Fortsetzung)</b>			
280	Porsche Automobil Holding SE - Preference	18.477	0,03
37	Sartorius AG - Preference	12.897	0,02
237	Volkswagen AG - Preference	31.571	0,06
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>79.767</b>	<b>0,14</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: – %)</b>			
694	Grifols SA - Preference	8.184	0,02
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>8.184</b>	<b>0,02</b>
<b>Vorzugsaktien insgesamt</b>		<b>87.951</b>	<b>0,16</b>
<b>Bezugsrechte (30. Juni 2021: -%)</b>			
<b>Israel (30. Juni 2021: – %)</b>			
11	Shikun & Binui Ltd (Rights) 07/07/2022	65	0,00
<b>Israel insgesamt</b>		<b>65</b>	<b>0,00</b>
<b>Bezugsrechte insgesamt</b>		<b>65</b>	<b>0,00</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		55.805.305	99,60
Vorzugsaktien		87.951	0,16
Bezugsrechte		65	0,00
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		134.822	0,24
		<b>56.028.143</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,75
Sonstige Vermögenswerte			0,25
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

\*Diese Wertpapiere werden mit Null bewertet

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %)</b>			
<b>Österreich (30. Juni 2021: 0,72 %)</b>			
8.225	ams-OSRAM AG	70.658	0,04
2.252	ANDRITZ AG	86.567	0,04
2.769	BAWAG Group AG '144A'	111.203	0,06
1.242	CA Immobilien Anlagen AG	37.571	0,02
10.166	Erste Group Bank AG	246.017	0,13
1.185	EVN AG	23.937	0,01
1.959	IMMOFINANZ AG	28.366	0,01
437	Mayr Melnhof Karton AG	70.794	0,04
4.500	OMV AG	201.420	0,10
4.267	Raiffeisen Bank International AG	44.121	0,02
1.021	Verbund AG	95.310	0,05
1.041	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	22.694	0,01
3.387	voestalpine AG	68.688	0,04
3.521	Wienerberger AG	72.110	0,04
	<b>Österreich insgesamt</b>	<b>1.179.456</b>	<b>0,61</b>
<b>Belgien (30. Juni 2021: 2,05 %)</b>			
691	Ackermans & van Haaren NV	98.467	0,05
5.020	Ageas SA/NV	210.740	0,11
22.956	Anheuser-Busch InBev SA/NV	1.179.020	0,61
2.207	Azelis Group NV	46.082	0,02
693	D'ieren Group	96.743	0,05
961	Elia Group SA/NV	129.927	0,07
1.674	Etablissements Franz Colruyt NV	43.440	0,02
3.137	Groupe Bruxelles Lambert SA	249.956	0,13
8.820	KBC Group NV	472.223	0,24
4.396	Proximus SADP	61.830	0,03
470	Sofina SA	91.650	0,05

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Belgien (30. Juni 2021: 2,05 %) (Fortsetzung)</b>			
2.304	Solvay SA	178.145	0,09
1.341	Telenet Group Holding NV	26.565	0,01
3.665	UCB SA	295.546	0,15
6.280	Umicore SA	209.250	0,11
541	VGP NV	82.232	0,04
4.475	Warehouses De Pauw CVA (REIT)	134.250	0,07
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>3.606.066</b>	<b>1,85</b>
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 0,18 %)</b>			
18.595	AutoStore Holdings Ltd '144A'	25.204	0,01
2.715	HAL Trust	333.402	0,17
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>358.606</b>	<b>0,18</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 5,05 %)</b>			
88	AP Moller - Maersk A/S - Class A	193.474	0,10
159	AP Moller - Maersk A/S - Class B	353.955	0,18
3.003	Carlsberg AS	365.044	0,19
3.230	Chr Hansen Holding A/S	224.377	0,12
3.853	Coloplast A/S	418.839	0,21
21.359	Danske Bank A/S	288.074	0,15
3.106	Demant A/S	111.223	0,06
5.965	DSV A/S	795.049	0,41
2.038	Genmab A/S	629.487	0,32
4.019	GN Store Nord AS	134.405	0,07
52.022	Novo Nordisk A/S	5.506.733	2,82
6.406	Novozymes A/S	366.960	0,19
5.626	Orsted AS '144A'	561.264	0,29
2.975	Pandora A/S	178.620	0,09

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 5,05 %) (Fortsetzung)</b>			
11.315	Tryg A/S	242.454	0,12
31.617	Vestas Wind Systems A/S	637.300	0,33
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>11.007.258</b>	<b>5,65</b>
<b>Färöer-Inseln (30. Juni 2021: 0,05 %)</b>			
1.566	Bakkafrost P/F	95.518	0,05
<b>Färöer Inseln insgesamt</b>		<b>95.518</b>	<b>0,05</b>
<b>Finnland (30. Juni 2021: 2,75 %)</b>			
4.604	Elisa Oyj	246.867	0,13
13.356	Fortum Oyj	191.191	0,10
2.994	Huhtamaki Oyj	113.173	0,06
7.581	Kesko Oyj	170.648	0,09
11.113	Kone Oyj - Class B	504.086	0,26
21.794	Metso Outotec Oyj	155.827	0,08
14.923	Neste Oyj	630.348	0,32
165.341	Nokia Oyj	734.031	0,37
100.528	Nordea Bank Abp	844.033	0,43
3.113	Orion Oyj	132.614	0,07
12.783	Sampo Oyj - Class A	530.750	0,27
18.223	Stora Enso Oyj	272.707	0,14
16.606	UPM-Kymmene Oyj	481.740	0,25
17.306	Wartsila OYJ Abp	128.584	0,06
<b>Finnland insgesamt</b>		<b>5.136.599</b>	<b>2,63</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 19,41 %)</b>			
1.037	Aeroports de Paris	125.322	0,06
16.882	Air Liquide SA	2.162.922	1,11

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 19,41 %) (Fortsetzung)</b>			
1.946	Amundi SA '144A'	101.581	0,05
70.798	AXA SA	1.533.485	0,79
1.282	BioMerieux	119.482	0,06
36.150	BNP Paribas SA	1.639.945	0,84
28.274	Bollore SE	124.971	0,06
9.320	Bouygues SA	273.635	0,14
5.105	Capgemini SE	834.412	0,43
18.416	Carrefour SA	310.954	0,16
14.255	Cie de Saint-Gobain	583.671	0,30
20.496	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	532.384	0,27
44.437	Credit Agricole SA	387.979	0,20
20.695	Danone SA	1.102.216	0,57
21.422	Dassault Systemes SE	752.234	0,39
35.962	Electricite de France SA	280.719	0,14
55.014	Engie SA	603.284	0,31
9.694	EssilorLuxottica SA	1.385.273	0,71
1.482	Euroapi SA	22.310	0,01
1.098	Hermes International	1.171.566	0,60
2.348	Kering SA	1.150.755	0,59
8.235	Legrand SA	580.238	0,30
7.755	L'Oreal SA	2.553.722	1,31
8.332	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	4.846.724	2,49
62.759	Orange SA	704.156	0,36
5.798	Pernod Ricard SA	1.016.389	0,52
12.235	Safran SA	1.152.659	0,59
34.629	Sanofi	3.336.158	1,71
759	Sartorius Stedim Biotech	227.169	0,12
17.886	Schneider Electric SE	2.019.329	1,04

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 19,41 %) (Fortsetzung)</b>			
25.636	Societe Generale SA	535.536	0,28
2.617	Sodexo SA	175.496	0,09
1.810	Teleperformance	530.873	0,27
3.319	Thales SA	388.489	0,20
83.720	TotalEnergies SE	4.216.976	2,16
18.373	Vinci SA	1.560.970	0,80
22.399	Vivendi SE	217.181	0,11
6.756	Worldline SA/France '144A'	239.027	0,12
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>39.500.192</b>	<b>20,26</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 17,75 %)</b>			
5.259	adidas AG	887.509	0,45
12.740	Allianz SE	2.320.209	1,19
29.876	BASF SE	1.240.601	0,64
31.671	Bayer AG	1.796.379	0,92
10.104	Bayerische Motoren Werke AG	742.240	0,38
3.075	Beiersdorf AG	299.751	0,15
2.959	BioNTech SE ADR	421.805	0,22
1.157	Carl Zeiss Meditec AG	131.782	0,07
3.396	Continental AG	225.834	0,12
5.902	Covestro AG '144A'	194.648	0,10
12.292	Daimler Truck Holding AG	306.194	0,16
4.836	Delivery Hero SE '144A'	172.984	0,09
58.618	Deutsche Bank AG	487.585	0,25
5.768	Deutsche Boerse AG	920.573	0,47
31.935	Deutsche Post AG	1.141.357	0,58
104.877	Deutsche Telekom AG	1.987.000	1,02
67.077	E.ON SE	537.153	0,27

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 17,75 %) (Fortsetzung)</b>			
5.557	Evonik Industries AG	113.141	0,06
6.251	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	297.735	0,15
12.365	Fresenius SE & Co KGaA	357.348	0,18
1.893	Hannover Rueck SE	262.180	0,13
764	Hapag-Lloyd AG '144A'	188.708	0,10
4.562	HeidelbergCement AG	209.122	0,11
3.918	Henkel AG & Co KGaA	228.811	0,12
37.862	Infineon Technologies AG	874.234	0,45
2.072	Knorr-Bremse AG	112.758	0,06
26.879	Mercedes-Benz Group AG	1.484.258	0,76
4.066	Merck KGaA	654.626	0,34
1.636	MTU Aero Engines AG	284.173	0,15
4.520	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	1.013.384	0,52
3.163	Puma SE	198.763	0,10
33.479	SAP SE	2.910.329	1,49
26.488	Siemens AG	2.571.720	1,32
13.696	Siemens Energy AG	191.539	0,10
8.717	Siemens Healthineers AG '144A'	422.687	0,22
4.044	Symrise AG - Class A	419.969	0,21
1.690	Talanx AG	61.381	0,03
24.714	Telefonica Deutschland Holding AG	67.716	0,03
1.565	Vantage Towers AG	41.629	0,02
891	Volkswagen AG	154.945	0,08
24.457	Vonovia SE	719.036	0,37
7.056	Zalando SE '144A'	176.118	0,09
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>27.829.914</b>	<b>14,27</b>

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland (30. Juni 2021: 2,01 %)</b>			
24.787	AIB Group Plc	53.887	0,03
24.130	CRH Plc	796.290	0,41
5.469	Flutter Entertainment Plc	527.649	0,27
2.549	ICON Plc	528.353	0,27
13.209	James Hardie Industries Plc CDI	276.032	0,14
4.913	Kerry Group Plc	448.754	0,23
4.806	Kingspan Group Plc	275.864	0,14
34.284	Ryanair Holdings Plc	386.552	0,20
8.148	Smurfit Kappa Group Plc	261.388	0,13
	<b>Irland insgesamt</b>	<b>3.554.769</b>	<b>1,82</b>
<b>Italien (30. Juni 2021: 4,11 %)</b>			
49.346	A2A SpA	59.807	0,03
3.917	Amplifon SpA	114.572	0,06
38.630	Assicurazioni Generali SpA	588.142	0,30
16.709	Atlantia SpA	373.947	0,19
6.745	Banca Mediolanum SpA	42.345	0,02
3.338	Buzzi Unicem SpA	52.106	0,03
282	DiaSorin SpA	35.306	0,02
250.801	Enel SpA	1.309.181	0,67
76.877	Eni SpA	870.863	0,45
19.229	FinecoBank Banca Fineco SpA	219.595	0,11
26.860	Hera SpA	74.134	0,04
10.986	Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A'	106.388	0,05
2.302	Interpump Group SpA	83.747	0,04
540.161	Intesa Sanpaolo SpA	961.487	0,49
12.393	Leonardo SpA	119.939	0,06
20.300	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	167.637	0,09

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Italien (30. Juni 2021: 4,11 %) (Fortsetzung)</b>			
6.543	Moncler SpA	267.805	0,14
26.130	Nexi SpA '144A'	206.532	0,11
12.113	Pirelli & C SpA '144A'	46.950	0,02
14.550	Poste Italiane SpA '144A'	129.670	0,07
16.100	PRADA SpA	86.254	0,04
7.961	Prysmian SpA	208.658	0,11
3.066	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	127.270	0,07
59.949	Snam SpA	299.685	0,15
997	Stevanato Group SpA	15.077	0,01
330.084	Telecom Italia SpA/Milano	82.422	0,04
173.157	Telecom Italia SpA/Milano	41.246	0,02
44.389	Terna - Rete Elettrica Nazionale	332.385	0,17
62.648	UniCredit SpA	567.904	0,29
12.806	UnipolSai Assicurazioni SpA	29.249	0,02
	<b>Italien insgesamt</b>	<b>7.620.303</b>	<b>3,91</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 0,65 %)</b>			
12.174	Allegro.eu SA '144A'	61.761	0,03
18.150	ArcelorMittal SA	390.406	0,20
4.044	Eurofins Scientific SE	303.624	0,16
6.472	InPost SA	35.803	0,02
5.395	Millicom International Cellular SA SDR	73.524	0,04
14.666	Tenaris SA	179.952	0,09
	<b>Luxemburg insgesamt</b>	<b>1.045.070</b>	<b>0,54</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 11,32 %)</b>			
13.951	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A'	149.485	0,08
870	Adyen NV '144A'	1.207.560	0,62

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 11,32 %) (Fortsetzung)</b>			
4.074	AerCap Holdings NV	159.538	0,08
18.782	Airbus SE	1.736.396	0,89
5.288	Akzo Nobel NV	331.135	0,17
1.688	Argenx SE ADR	611.744	0,31
1.417	ASM International NV	338.096	0,17
12.856	ASML Holding NV	5.860.408	3,01
16.472	Davide Campari-Milano NV	165.296	0,08
3.366	EXOR NV	200.210	0,10
4.048	Ferrari NV	709.210	0,36
3.165	Heineken Holding NV	219.809	0,11
7.491	Heineken NV	651.717	0,33
122.474	ING Groep NV	1.155.052	0,59
2.981	JDE Peet's NV	80.964	0,04
31.923	Koninklijke Ahold Delhaize NV	793.606	0,41
5.419	Koninklijke DSM NV	742.945	0,38
100.400	Koninklijke KPN NV	341.460	0,18
27.408	Koninklijke Philips NV	563.371	0,29
8.396	NN Group NV	363.883	0,19
8.470	NXP Semiconductors NV	1.199.303	0,61
27.636	Prosus NV	1.726.697	0,89
3.682	Randstad NV	170.108	0,09
67.856	Stellantis NV	800.158	0,41
20.583	STMicroelectronics NV	617.490	0,32
29.633	Universal Music Group NV	566.998	0,29
8.133	Wolters Kluwer NV	752.790	0,39
	<b>Niederlande insgesamt</b>	<b>22.215.429</b>	<b>11,39</b>
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 1,79 %)</b>			
12.619	Adevinta ASA	86.926	0,04
693	Aker ASA	50.723	0,03

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 1,79 %) (Fortsetzung)</b>			
3.963	Aker BP ASA	131.259	0,07
2.686	Austevoll Seafood ASA	29.984	0,02
27.809	DNB Bank ASA	475.341	0,24
1.860	Entra ASA '144A'	22.240	0,01
33.550	Equinor ASA	1.112.675	0,57
5.821	Gjensidige Forsikring ASA	112.433	0,06
2.716	Kongsberg Gruppen ASA	92.823	0,05
8.839	Leroy Seafood Group ASA	59.861	0,03
13.054	Mowi ASA	283.229	0,15
48.813	NEL ASA	56.546	0,03
5.211	Nordic Semiconductor ASA	77.090	0,04
42.067	Norsk Hydro ASA	224.656	0,11
23.249	Orkla ASA	177.191	0,09
1.781	Salmar ASA	119.408	0,06
3.550	Scatec ASA '144A'	29.098	0,01
2.667	Schibsted ASA	45.419	0,02
2.332	Schibsted ASA - Class B	36.237	0,02
5.417	SpareBank 1 SR-Bank ASA	55.960	0,03
14.383	Storebrand ASA	97.616	0,05
20.157	Telenor ASA	255.652	0,13
7.377	TOMRA Systems ASA	130.473	0,07
8.354	Var Energi ASA	31.264	0,02
5.092	Yara International ASA	202.916	0,10
	<b>Norwegen insgesamt</b>	<b>3.997.020</b>	<b>2,05</b>
<b>Polen (30. Juni 2021: 0,56 %)</b>			
5.594	Bank Polska Kasa Opieki SA	97.046	0,05
2.180	CD Projekt SA	44.378	0,02
7.824	Cyfrowy Polsat SA	35.323	0,02

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Polen (30. Juni 2021: 0,56 %) (Fortsetzung)</b>			
1.506	Dino Polska SA '144A'	102.212	0,05
2.709	Grupa Lotos SA	39.608	0,02
4.306	KGHM Polska Miedz SA	108.929	0,06
416	mBank SA	19.879	0,01
9.765	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	142.356	0,07
51.283	Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA	62.323	0,03
27.893	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	166.165	0,09
18.038	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	115.055	0,06
1.048	Santander Bank Polska SA	51.952	0,03
<b>Polen insgesamt</b>		<b>985.226</b>	<b>0,51</b>
<b>Portugal (30. Juni 2021: 0,28 %)</b>			
230.878	Banco Comercial Portugues SA	38.095	0,02
87.200	EDP - Energias de Portugal SA	388.214	0,20
15.409	Galp Energia SGPS SA	172.350	0,09
8.681	Jeronimo Martins SGPS SA	180.044	0,09
6.525	Navigator Co SA/The	25.030	0,01
<b>Portugal insgesamt</b>		<b>803.733</b>	<b>0,41</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: 5,02 %)</b>			
7.456	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	172.457	0,09
2.223	Aena SME SA '144A'	269.539	0,14
14.160	Amadeus IT Group SA	752.746	0,39
199.025	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	861.878	0,44
547.174	Banco Santander SA	1.470.804	0,75
136.582	CaixaBank SA	453.042	0,23
17.673	Cellnex Telecom SA '144A'	654.431	0,34
1.779	Corp ACCIONA Energias Renovables SA	65.432	0,03

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien (30. Juni 2021: 5,02 %) (Fortsetzung)</b>			
7.563	EDP Renovaveis SA	170.319	0,09
9.947	Endesa SA	179.046	0,09
15.348	Ferrovial SA	371.268	0,19
9.611	Grifols SA	173.334	0,09
197.380	Iberdrola SA	1.953.272	1,00
34.898	Industria de Diseno Textil SA	753.448	0,39
29.540	Mapfre SA	49.686	0,02
10.432	Naturgy Energy Group SA	286.567	0,15
12.636	Red Electrica Corp SA	227.764	0,12
45.642	Repsol SA	641.270	0,33
7.043	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	126.140	0,06
159.806	Telefonica SA	776.977	0,40
	<b>Spanien insgesamt</b>	<b>10.409.420</b>	<b>5,34</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 8,34 %)</b>			
5.445	AAK AB	84.827	0,04
7.176	AddTech AB	89.355	0,05
5.877	Akelius Residential Property AB	10.896	0,01
9.272	Alfa Laval AB	213.427	0,11
30.610	Assa Abloy AB	620.876	0,32
81.522	Atlas Copco AB	727.241	0,37
47.532	Atlas Copco AB	379.522	0,19
3.359	Avanza Bank Holding AB	53.819	0,03
3.394	Axfood AB	93.236	0,05
7.193	Beijer Ref AB - Class B	93.931	0,05
8.341	Boliden AB	253.309	0,13
7.637	Castellum AB	93.706	0,05
7.902	Electrolux AB	101.538	0,05

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (30. Juni 2021: 8,34 %) (Fortsetzung)</b>			
10.378	Elektä AB	68.449	0,03
23.174	Embracer Group AB - Class B	168.703	0,09
13.642	Epiroc AB	175.982	0,09
19.794	Epiroc AB	291.834	0,15
10.998	EQT AB	214.967	0,11
18.988	Essity AB	473.408	0,24
5.613	Evolution AB '144A'	487.312	0,25
8.206	Fabege AB	73.978	0,04
16.973	Fastighets AB Balder - Class B	77.647	0,04
6.215	Getinge AB	137.142	0,07
22.212	H & M Hennes & Mauritz AB	253.279	0,13
63.165	Hexagon AB	626.452	0,32
2.839	Holmen AB	109.949	0,06
12.686	Husqvarna AB	89.095	0,05
5.328	Industrivarden AB	113.143	0,06
3.348	Industrivarden AB - Class A	71.940	0,04
8.402	Indutrade AB	146.305	0,07
4.277	Investment AB Latour	80.764	0,04
18.775	Investor AB	321.850	0,16
57.936	Investor AB	909.505	0,47
7.625	Kinnevik AB	117.295	0,06
2.290	L E Lundbergforetagen AB	88.901	0,05
6.184	Lifco AB	94.811	0,05
5.906	Lundin Energy Mergerco AB	184.911	0,09
50.548	Nibe Industrier AB	362.366	0,19
5.906	Orron Energy ab	3.854	0,00
2.410	Saab AB	95.067	0,05
12.816	Sagax AB	27.574	0,01

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (30. Juni 2021: 8,34 %) (Fortsetzung)</b>			
4.576	Sagax AB	80.601	0,04
7.196	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	10.472	0,00
32.807	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	52.166	0,03
33.085	Sandvik AB	512.187	0,26
9.747	Securitas AB	80.173	0,04
18.190	Sinch AB '144A'	56.532	0,03
46.109	Skandinaviska Enskilda Banken AB - Class A	432.117	0,22
10.690	Skanska AB	156.461	0,08
11.165	SKF AB	156.847	0,08
7.976	SSAB AB	33.257	0,02
19.266	SSAB AB - Class B	76.106	0,04
42.870	Storskogen Group AB	57.903	0,03
18.876	Svenska Cellulosa AB SCA - Class B	269.225	0,14
45.150	Svenska Handelsbanken AB - Class A	368.426	0,19
1.962	Svenska Handelsbanken AB - Class B	18.424	0,01
6.381	Sweco AB	63.315	0,03
34.387	Swedbank AB	415.026	0,21
48.839	Swedish Match AB	475.025	0,24
5.799	Swedish Orphan Biovitrum AB	119.735	0,06
15.573	Tele2 AB	169.348	0,09
92.031	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	655.194	0,34
68.544	Telia Co AB	250.678	0,13
3.262	Thule Group AB '144A'	76.517	0,04
7.488	Trelleborg AB	144.054	0,07
2.415	Vitrolife AB	53.020	0,03
46.890	Volvo AB	693.207	0,35
6.199	Volvo AB	95.243	0,05
15.087	Volvo Car AB	95.706	0,05
11.275	Wallenstam AB	47.097	0,02
	<b>Schweden insgesamt</b>	<b>14.396.228</b>	<b>7,38</b>

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,80 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 17,76 %)</b>			
54.763	ABB Ltd	1.393.067	0,71
15.421	Alcon Inc	1.027.388	0,53
14.473	Cie Financiere Richemont SA	1.469.915	0,75
76.171	Credit Suisse Group AG	412.492	0,21
1.087	Geberit AG	498.287	0,26
250	Givaudan SA	838.528	0,43
17.734	Holcim AG	723.811	0,37
1.605	Kuehne + Nagel International AG	362.418	0,19
2.453	Lonza Group AG	1.247.503	0,64
89.233	Nestle SA	9.935.572	5,10
73.218	Novartis AG	5.914.584	3,03
691	Partners Group Holding AG	593.887	0,30
22.398	Roche Holding AG	7.128.746	3,66
851	Roche Holding AG	313.239	0,16
1.099	Schindler Holding AG	191.171	0,10
797	Schindler Holding AG	136.648	0,07
190	SGS SA	414.793	0,21
5.002	Sika AG	1.099.493	0,56
3.252	Straumann Holding AG	372.521	0,19
887	Swatch Group AG/The	200.733	0,10
1.602	Swatch Group AG/The	67.930	0,04
9.074	Swiss Re AG	670.717	0,34
797	Swisscom AG	419.976	0,22
103.805	UBS Group AG	1.596.185	0,82
4.871	Zurich Insurance Group AG	2.020.700	1,04
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>39.050.304</b>	<b>20,03</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>192.791.111</b>	<b>98,88</b>

## L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Vorzugsaktien (3. Juni 2021: – %)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: – %)</b>			
1.791	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	121.072	0,06
4.655	Henkel AG & Co KGaA - Preference	273.621	0,14
4.823	Porsche Automobil Holding SE - Preference	304.428	0,16
1.072	Sartorius AG - Preference	357.405	0,18
6.020	Volkswagen AG - Preference	767.068	0,40
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>1.823.594</b>	<b>0,94</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: – %)</b>			
7.636	Grifols SA - Preference	86.134	0,04
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>86.134</b>	<b>0,04</b>
<b>Vorzugsaktien Insgesamt</b>		<b>1.909.728</b>	<b>0,98</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		192.791.111	98,88
Vorzugsaktien		1.909.728	0,98
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		266.268	0,14
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>194.967.107</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,86
Sonstige Vermögenswerte			0,14
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 57,34 %)</b>			
91.955	Allkem Ltd	651.945	0,25
357.837	Alumina Ltd	360.495	0,14
478.781	AMP Ltd	314.425	0,12
32.637	Ampol Ltd	768.234	0,29
159.831	APA Group	1.238.687	0,47
87.544	Aristocrat Leisure Ltd	2.069.707	0,78
26.787	ASX Ltd	1.505.137	0,57
244.678	Aurizon Holdings Ltd	639.374	0,24
388.023	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	5.878.258	2,23
708.162	BHP Group Ltd	20.087.839	7,61
68.558	BlueScope Steel Ltd	749.604	0,28
44.015	Boral Ltd	78.393	0,03
201.611	Brambles Ltd	1.484.842	0,56
40.871	carsales.com Ltd	516.861	0,20
63.118	Charter Hall Group (REIT)	470.066	0,18
9.114	Cochlear Ltd	1.245.327	0,47
173.687	Coles Group Ltd	2.127.198	0,81
238.059	Commonwealth Bank of Australia	14.795.634	5,61
75.620	Computershare Ltd	1.281.309	0,49
66.844	CSL Ltd	12.367.679	4,69
152.098	Dexus (REIT)	928.781	0,35
8.304	Domino's Pizza Enterprises Ltd	388.305	0,15
178.040	Endeavour Group Ltd/Australia	926.809	0,35
254.649	Evolution Mining Ltd	416.769	0,16
249.805	Fortescue Metals Group Ltd	3.011.339	1,14
253.765	Goodman Group (REIT)	3.113.173	1,18
273.519	GPT Group/The (REIT)	793.737	0,30
29.355	IDP Education Ltd	480.840	0,18
105.443	IGO Ltd	720.744	0,27
347.589	Insurance Australia Group Ltd	1.042.147	0,39

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 57,34 %) (Fortsetzung)</b>			
97.697	Lendlease Corp Ltd	612.035	0,23
303.658	Lottery Corp Ltd/The	943.843	0,36
127.626	Lynas Rare Earths Ltd	766.179	0,29
52.008	Macquarie Group Ltd	5.883.545	2,23
383.341	Medibank Pvt Ltd	856.733	0,32
23.176	Mineral Resources Ltd	769.294	0,29
561.860	Mirvac Group (Units) (REIT)	763.083	0,29
450.632	National Australia Bank Ltd	8.487.713	3,22
124.388	Newcrest Mining Ltd	1.786.873	0,68
162.642	Northern Star Resources Ltd	765.007	0,29
57.667	Orica Ltd	625.368	0,24
246.988	Origin Energy Ltd	973.211	0,37
44.432	OZ Minerals Ltd	542.645	0,21
323.056	Pilbara Minerals Ltd	508.733	0,19
267.640	Qantas Airways Ltd	822.688	0,31
208.591	QBE Insurance Group Ltd	1.742.804	0,66
26.116	Ramsay Health Care Ltd	1.315.321	0,50
6.854	REA Group Ltd	527.083	0,20
41.079	Reece Ltd	389.265	0,15
51.901	Rio Tinto Ltd	3.665.412	1,39
471.768	Santos Ltd	2.407.183	0,91
737.631	Scentre Group (REIT)	1.313.759	0,50
44.869	SEEK Ltd	647.951	0,25
24.154	Seven Group Holdings Ltd	275.890	0,10
66.121	Sonic Healthcare Ltd	1.500.934	0,57
641.458	South32 Ltd	1.737.965	0,66
313.219	Stockland (REIT)	777.557	0,29
179.473	Suncorp Group Ltd	1.355.121	0,51
321.117	Tabcorp Holdings Ltd	235.174	0,09
1.611.399	Telstra Corp Ltd	4.266.193	1,62
54.104	TPG Telecom Ltd	222.116	0,08

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 57,34 %) (Fortsetzung)</b>			
426.263	Transurban Group	4.215.151	1,60
99.641	Treasury Wine Estates Ltd	777.697	0,29
553.115	Vicinity Centres (REIT)	697.956	0,26
157.017	Wesfarmers Ltd	4.525.233	1,72
488.435	Westpac Banking Corp	6.549.649	2,48
22.463	WiseTech Global Ltd	584.669	0,22
264.907	Woodside Energy Group Ltd	5.800.202	2,20
167.310	Woolworths Group Ltd	4.095.892	1,55
	<b>Australien insgesamt</b>	<b>155.186.785</b>	<b>58,81</b>
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 1,89 %)</b>			
581.805	Alibaba Health Information Technology Ltd	400.377	0,15
306.371	China Gas Holdings Ltd	473.204	0,18
61.808	CK Infrastructure Holdings Ltd	378.868	0,15
28.086	DFI Retail Group Holdings Ltd	82.292	0,03
163.053	Hongkong Land Holdings Ltd	818.526	0,31
33.584	Jardine Matheson Holdings Ltd	1.765.175	0,67
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>3.918.442</b>	<b>1,49</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 6,25 %)</b>			
43.680	ASMP T Ltd	371.006	0,14
232.900	Budweiser Brewing Co APAC Ltd '144A'	697.486	0,26
424.680	China Mengniu Dairy Co Ltd	2.118.809	0,80
246.285	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	463.257	0,18
274.542	CK Asset Holdings Ltd	1.941.779	0,74
370.759	CK Hutchison Holdings Ltd	2.506.543	0,95
345.800	ESR Group Ltd '144A'	934.241	0,35
11.152	Futu Holdings Ltd ADR	582.246	0,22
834.623	Geely Automobile Holdings Ltd	1.897.507	0,72
361.614	Grab Holdings Ltd	914.883	0,35
131.236	JS Global Lifestyle Co Ltd '144A'	170.924	0,07

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 6,25 %) (Fortsetzung)</b>			
344.353	Sands China Ltd	821.501	0,31
59.246	Sea Ltd ADR	3.961.188	1,50
205.764	Shimao Group Holdings Ltd*	–	–
1.345.350	Sino Biopharmaceutical Ltd	852.099	0,32
1.022.265	WH Group Ltd '144A'	789.467	0,30
208.148	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	992.069	0,38
223.986	Xinyi Glass Holdings Ltd	537.203	0,20
	<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>	<b>20.552.208</b>	<b>7,79</b>
<b>Hongkong (30. Juni 2021: 20,83 %)</b>			
1.692.495	AIA Group Ltd	18.344.245	6,95
153.592	Bank of East Asia Ltd/The	216.091	0,08
91.500	BYD Electronic International Co Ltd	288.599	0,11
137.000	Cathay Pacific Airways Ltd	149.973	0,06
542.000	China Evergrande New Energy Vehicle Group Ltd*	–	–
1.170.526	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	1.162.028	0,44
323.494	Fosun International Ltd	298.884	0,11
300.357	Galaxy Entertainment Group Ltd	1.791.355	0,68
253.839	Hang Lung Properties Ltd	481.348	0,18
99.539	Hang Seng Bank Ltd	1.756.876	0,67
186.136	Henderson Land Development Co Ltd	697.390	0,26
1.436.595	Hong Kong & China Gas Co Ltd	1.546.996	0,59
177.315	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	8.722.298	3,31
288.029	Link REIT (Units) (REIT)	2.349.169	0,89
224.362	MTR Corp Ltd	1.172.280	0,44
191.211	New World Development Co Ltd	685.945	0,26
183.682	Power Assets Holdings Ltd	1.155.186	0,44
441.832	Sino Land Co Ltd	652.024	0,25
200.091	Sun Hung Kai Properties Ltd	2.363.771	0,90
68.090	Swire Pacific Ltd	405.661	0,15
145.205	Swire Properties Ltd	360.470	0,14

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Hongkong (30. Juni 2021: 20,83 %) (Fortsetzung)</b>			
192.577	Techtronic Industries Co Ltd	2.008.729	0,76
191.769	Wharf Holdings Ltd/The	698.944	0,26
<b>Hongkong insgesamt</b>		<b>47.308.262</b>	<b>17,93</b>
<b>International (30. Juni 2021: – %)</b>			
539.342	HKT Trust & HKT Ltd	724.441	0,27
<b>International insgesamt</b>		<b>724.441</b>	<b>0,27</b>
<b>Neuseeland (30. Juni 2021: 3,49 %)</b>			
98.967	a2 Milk Co Ltd/The	303.353	0,12
164.820	Auckland International Airport Ltd	735.775	0,28
55.311	Chorus Ltd	248.290	0,09
107.944	Contact Energy Ltd	488.585	0,19
21.481	EBOS Group Ltd	521.004	0,20
78.134	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	970.613	0,37
113.007	Fletcher Building Ltd	354.117	0,13
137.485	Goodman Property Trust (Units) (REIT)	170.961	0,06
94.312	Infratil Ltd	450.338	0,17
11.014	Mainfreight Ltd	478.666	0,18
85.082	Mercury NZ Ltd	298.880	0,11
154.130	Meridian Energy Ltd	448.481	0,17
51.661	Ryman Healthcare Ltd	285.867	0,11
235.435	Spark New Zealand Ltd	702.624	0,27
18.570	Xero Ltd	982.774	0,37
<b>Neuseeland insgesamt</b>		<b>7.440.328</b>	<b>2,82</b>
<b>Singapur (30. Juni 2021: 9,24 %)</b>			
477.613	Ascendas Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	978.082	0,37
719.490	CapitaLand Integrated Commercial Trust (Units) (REIT)	1.121.861	0,43
713.562	Capitaland Investment Ltd/Singapore	1.958.617	0,74
10.553	CDL Hospitality Trusts	9.630	0,00

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung		Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Singapur (30. Juni 2021: 9,24 %) (Fortsetzung)</b>				
74.576	City Developments Ltd		436.728	0,17
250.896	DBS Group Holdings Ltd		5.350.718	2,03
349.000	Frasers Logistics & Commercial Trust (Units) (REIT)		333.527	0,13
710.945	Genting Singapore Ltd		367.810	0,14
12.720	Jardine Cycle & Carriage Ltd		258.568	0,10
198.256	Keppel Corp Ltd		924.539	0,35
171.986	Keppel DC REIT (Units) (REIT)		243.452	0,09
273.965	Mapletree Commercial Trust (REIT)		360.247	0,14
268.355	Mapletree Industrial Trust (Units) (REIT)		501.346	0,19
439.283	Mapletree Logistics Trust (Units) (REIT)		530.284	0,20
153.764	Olam Group Ltd		167.939	0,06
544.037	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd		4.452.527	1,69
81.991	SATS Ltd		229.766	0,09
178.030	Singapore Airlines Ltd		652.406	0,25
109.245	Singapore Exchange Ltd		742.587	0,28
194.674	Singapore Technologies Engineering Ltd		570.719	0,22
1.134.936	Singapore Telecommunications Ltd		2.063.224	0,78
230.091	Suntec Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)		267.836	0,10
196.132	United Overseas Bank Ltd		3.699.407	1,40
60.480	UOL Group Ltd		319.848	0,12
35.380	Venture Corp Ltd		422.770	0,16
240.492	Wilmar International Ltd (Units)		698.130	0,26
402.637	Yangzijiang Financial Holding Ltd		118.618	0,04
398.037	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd		265.987	0,10
	<b>Singapur insgesamt</b>		<b>28.047.173</b>	<b>10,63</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>263.177.639</b>	<b>99,74</b>
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 0,02 %)</b>				
<b>Singapur (30. Juni 2021: 0,02 %)</b>				
41.571	Singapore Airlines Ltd (Zero Coupon)	08.06.2030	30.020	0,01
	<b>Singapur insgesamt</b>		<b>30.020</b>	<b>0,01</b>
	<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>		<b>30.020</b>	<b>0,01</b>

## L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Gesamtanlagen	Wert \$	% des Netto- vermö- gens
Stammaktien	263.177.639	99,74
Unternehmensanleihen	30.020	0,01
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	661.076	0,25
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>263.868.735</b>	<b>100,00</b>

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,46
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	0,01
Sonstige Vermögenswerte	0,53
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

\*Diese Wertpapiere werden mit Null bewertet

## L&amp;G Clean Water UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %)</b>			
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 2,58 %)</b>			
16.891.770	Beijing Enterprises Water Group Ltd	5.101.779	1,65
6.316.386	China Water Affairs Group Ltd	5.876.106	1,90
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>10.977.885</b>	<b>3,55</b>
<b>Brasilien (30. Juni 2021: 1,96 %)</b>			
794.900	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR	6.351.251	2,06
	<b>Brasilien insgesamt</b>	<b>6.351.251</b>	<b>2,06</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 1,93 %)</b>			
278.803	Primo Water Corp	3.730.384	1,21
	<b>Kanada insgesamt</b>	<b>3.730.384</b>	<b>1,21</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 3,07 %)</b>			
4.441.000	China Lesso Group Holdings Ltd	6.700.861	2,17
	<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>	<b>6.700.861</b>	<b>2,17</b>
<b>Finnland (30. Juni 2021: 4,17 %)</b>			
538.526	Kemira Oyj	6.564.620	2,12
929.912	Metso Outotec Oyj	6.951.079	2,25
270.605	Uponor Oyj	3.725.855	1,21
	<b>Finnland insgesamt</b>	<b>17.241.554</b>	<b>5,58</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 1,83 %)</b>			
144.859	Norma Group SE	3.225.741	1,04
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>3.225.741</b>	<b>1,04</b>
<b>Hongkong (30. Juni 2021: 1,47 %)</b>			
5.054.256	Guangdong Investment Ltd	5.346.055	1,73
	<b>Hongkong insgesamt</b>	<b>5.346.055</b>	<b>1,73</b>

## L&amp;G Clean Water UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland (30. Juni 2021: 2,06 %)</b>			
116.904	Pentair Plc	5.350.696	1,73
<b>Irland insgesamt</b>		<b>5.350.696</b>	<b>1,73</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 6,60 %)</b>			
525.566	Kitz Corp	2.448.811	0,79
165.371	Kurita Water Industries Ltd	5.976.752	1,94
213.560	METAWATER Co Ltd	3.162.804	1,02
92.173	Organo Corp	5.760.177	1,86
<b>Japan insgesamt</b>		<b>17.348.544</b>	<b>5,61</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 2,02 %)</b>			
144.934	Aalberts NV	5.635.089	1,82
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>5.635.089</b>	<b>1,82</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 1,97 %)</b>			
225.319	Alfa Laval AB	5.422.223	1,75
<b>Schweden insgesamt</b>		<b>5.422.223</b>	<b>1,75</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 4,43 %)</b>			
10.487	Geberit AG	5.025.801	1,63
93.826	Sulzer AG	5.811.772	1,88
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>10.837.573</b>	<b>3,51</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 9,54 %)</b>			
1.060.507	Genuit Group Plc	4.926.342	1,59
483.866	Pennon Group Plc	5.597.186	1,81
1.754.265	Rotork Plc	5.125.904	1,66
174.144	Severn Trent Plc	5.750.391	1,86
475.133	United Utilities Group Plc	5.885.658	1,91
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>27.285.481</b>	<b>8,83</b>

## L&amp;G Clean Water UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 56,10 %)</b>			
96.700	A O Smith Corp	5.287.556	1,71
54.746	Advanced Drainage Systems Inc	4.930.972	1,60
75.322	American States Water Co	6.139.496	1,99
41.215	American Water Works Co Inc	6.131.556	1,98
57.211	Artesian Resources Corp - Class A	2.813.065	0,91
67.992	Badger Meter Inc	5.499.873	1,78
174.486	Bentley Systems Inc - Class B	5.810.384	1,88
113.208	California Water Service Group	6.288.704	2,03
309.437	Core & Main Inc - Class A	6.900.445	2,23
24.354	Danaher Corp	6.174.226	2,00
39.483	Ecolab Inc	6.070.906	1,96
341.079	Energy Recovery Inc	6.623.754	2,14
155.552	Evoqua Water Technologies Corp	5.056.995	1,64
79.969	Franklin Electric Co Inc	5.858.529	1,90
171.999	Gorman-Rupp Co/The	4.867.572	1,57
105.206	Ingevity Corp	6.642.707	2,15
140.455	Itron Inc	6.942.691	2,25
33.611	Kadant Inc	6.128.966	1,98
48.161	Lindsay Corp	6.396.744	2,07
4.761	Mettler-Toledo International Inc	5.469.294	1,77
62.066	Middlesex Water Co	5.441.947	1,76
529.055	Mueller Water Products Inc - Class A	6.205.815	2,01
104.275	Northwest Pipe Co	3.121.993	1,01
360.983	NOV Inc	6.104.223	1,98
14.548	Roper Technologies Inc	5.741.368	1,86
97.182	SJW Group	6.065.129	1,96
1.909.451	TETRA Technologies Inc	7.752.371	2,51
99.476	Trimble Inc	5.792.487	1,87
46.070	Watts Water Technologies Inc - Class A	5.659.239	1,83
77.574	Xylem Inc/NY	6.064.735	1,96

## L&amp;G Clean Water UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,29 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 56,10 %) (Fortsetzung)</b>			
68.999	York Water Co/The	2.789.630	0,90
201.008	Zurn Elkay Water Solutions Corp	5.475.458	1,77
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>182.248.830</b>	<b>58,96</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>307.702.167</b>	<b>99,55</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		307.702.167	99,55
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.383.936	0,45
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>309.086.103</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			98,98
Sonstige Vermögenswerte			1,02
			<b>100,00</b>
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 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021 99,85 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 1,39 %)</b>			
635.010	Appen Ltd	2.449.740	1,10
<b>Australien insgesamt</b>		<b>2.449.740</b>	<b>1,10</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 1,41 %)</b>			
98.730	Shopify Inc	3.084.325	1,38
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>3.084.325</b>	<b>1,38</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 6,63 %)</b>			
40.973	Alibaba Group Holding Ltd ADR	4.657.810	2,09
43.141	Ambarella Inc	2.824.010	1,26
27.737	Baidu Inc ADR	4.125.324	1,85
56.163	JD.com Inc ADR	3.606.788	1,61
1.087.883	Kingdee International Software Group Co Ltd	2.550.928	1,14
76.289	Tencent Holdings Ltd	3.445.512	1,54
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>21.210.372</b>	<b>9,49</b>
<b>China (30. Juni 2021: 0,38 %)</b>			
144.948	Iflytek Co Ltd 'A'	891.192	0,40
<b>China insgesamt</b>		<b>891.192</b>	<b>0,40</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 1,50 %)</b>			
87.932	Dassault Systemes SE	3.228.078	1,45
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>3.228.078</b>	<b>1,45</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 1,18 %)</b>			
99.537	Infineon Technologies AG	2.402.773	1,08
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>2.402.773</b>	<b>1,08</b>

## L&amp;G Artificial Intelligence UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland (30. Juni 2021: 0,92 %)</b>			
9.044	Accenture Plc - Class A	2.511.067	1,12
<b>Irland insgesamt</b>		<b>2.511.067</b>	<b>1,12</b>
<b>Israel (30. Juni 2021: 3,75 %)</b>			
183.515	JFrog Ltd	3.866.661	1,73
14.955	Nice Ltd ADR	2.878.090	1,29
43.831	Wix.com Ltd	2.873.122	1,28
<b>Israel insgesamt</b>		<b>9.617.873</b>	<b>4,30</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 1,57 %)</b>			
25.219	Spotify Technology SA	2.366.299	1,06
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>2.366.299</b>	<b>1,06</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 2,77 %)</b>			
6.209	ASML Holding NV NY Reg Shrs	2.954.739	1,32
69.578	Yandex NV - Class A*	–	–
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>2.954.739</b>	<b>1,32</b>
<b>Polen (30. Juni 2021: 1,01 %)</b>			
93.721	CD Projekt SA	1.994.569	0,89
<b>Polen insgesamt</b>		<b>1.994.569</b>	<b>0,89</b>
<b>Taiwan (30. Juni 2021: 3,17 %)</b>			
185.604	Global Unichip Corp	3.002.523	1,35
116.579	MediaTek Inc	2.552.438	1,14
185.795	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.974.370	1,33
<b>Taiwan insgesamt</b>		<b>8.529.331</b>	<b>3,82</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 3,01 %)</b>			
20.874	Atlassian Corp Plc	3.911.788	1,75

## L&amp;G Artificial Intelligence UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 3,01 %) (Fortsetzung)</b>			
664.068	Darktrace Plc	2.375.882	1,06
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>6.287.670</b>	<b>2,81</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 71,16 %)</b>			
6.601	Adobe Inc	2.416.362	1,08
33.682	Advanced Micro Devices Inc	2.575.663	1,15
1.736	Alphabet Inc - Class A	3.783.195	1,69
69.091	Alteryx Inc - Class A	3.345.386	1,50
32.515	Amazon.com Inc	3.453.418	1,55
24.075	Analog Devices Inc	3.517.117	1,57
37.788	Arista Networks Inc	3.542.247	1,59
16.801	Autodesk Inc	2.889.100	1,29
40.213	Block Inc	2.471.491	1,11
1.499	Booking Holdings Inc	2.621.736	1,17
845.589	Butterfly Network Inc	2.595.958	1,16
132.342	C3.ai Inc	2.416.565	1,08
67.106	Cloudflare Inc	2.935.887	1,31
67.876	Cognex Corp	2.886.088	1,29
47.933	CoStar Group Inc	2.895.633	1,30
24.828	Electronic Arts Inc	3.020.326	1,35
41.265	Etsy Inc	3.021.011	1,35
9.271	Fair Isaac Corp	3.716.744	1,66
30.335	Fiserv Inc	2.698.905	1,21
9.412	HubSpot Inc	2.829.718	1,27
17.031	Illumina Inc	3.139.835	1,41
24.732	International Business Machines Corp	3.491.911	1,56
8.084	Intuit Inc	3.115.897	1,39
88.491	iRobot Corp	3.252.044	1,46
6.793	Lam Research Corp	2.894.837	1,30
120.582	Lemonade Inc	2.201.827	0,99

## L&amp;G Artificial Intelligence UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 71,16 %) (Fortsetzung)</b>			
4.425	MercadoLibre Inc	2.818.150	1,26
14.694	Microsoft Corp	3.773.860	1,69
11.911	MongoDB Inc - Class A	3.090.904	1,38
14.223	Netflix Inc	2.487.176	1,11
69.022	New Relic Inc	3.454.551	1,55
122.190	NortonLifeLock Inc	2.683.292	1,20
20.771	NVIDIA Corp	3.148.676	1,41
7.121	Palo Alto Networks Inc	3.517.347	1,57
126.287	Pure Storage Inc	3.246.839	1,45
49.626	Rapid7 Inc	3.315.017	1,48
21.029	Salesforce Inc	3.470.626	1,55
224.440	Samsara Inc	2.506.995	1,12
7.089	ServiceNow Inc	3.370.961	1,51
19.968	Snowflake Inc	2.776.750	1,24
37.604	Splunk Inc	3.326.450	1,49
32.503	Teradyne Inc	2.910.644	1,30
4.285	Tesla Inc	2.885.605	1,29
39.000	Twilio Inc - Class A	3.268.590	1,46
53.403	Upstart Holdings Inc	1.688.603	0,76
101.654	Varonis Systems Inc - Class B	2.980.495	1,33
18.575	Veeva Systems Inc - Class A	3.678.593	1,65
199.327	Veracyte Inc	3.966.607	1,78
20.106	Verisk Analytics Inc - Class A	3.480.148	1,56
673.072	Yext Inc	3.217.284	1,44
38.892	Zendesk Inc	2.880.730	1,29
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>155.673.794</b>	<b>69,66</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>223.201.822</b>	<b>99,88</b>

## L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	223.201.822	99,88
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	274.767	0,12
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>223.476.589</b>	<b>100,00</b>

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,83
Sonstige Vermögenswerte	0,17
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

\*Dieses Wertpapier wird mit null bewertet.

## L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,87 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 0,97 %)</b>			
7.757	CSL Ltd	1.435.224	1,15
<b>Australien insgesamt</b>		<b>1.435.224</b>	<b>1,15</b>
<b>Belgien (30. Juni 2021: 0,67 %)</b>			
81.296	Materialise NV ADR	1.107.252	0,88
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>1.107.252</b>	<b>0,88</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 0,76 %)</b>			
9.781	Novanta Inc	1.186.143	0,95
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>1.186.143</b>	<b>0,95</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 2,56 %)</b>			
246.030	JD Health International Inc '144A'	1.929.836	1,54
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>1.929.836</b>	<b>1,54</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 0,84 %)</b>			
30.449	GN Store Nord AS	1.064.573	0,85
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>1.064.573</b>	<b>0,85</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 1,41 %)</b>			
32.493	Siemens Healthineers AG '144A'	1.647.201	1,32
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>1.647.201</b>	<b>1,32</b>
<b>Italien (30. Juni 2021: 1,44 %)</b>			
14.951	DiaSorin SpA	1.956.947	1,56
<b>Italien insgesamt</b>		<b>1.956.947</b>	<b>1,56</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 0,74 %)</b>			
32.774	Terumo Corp	986.200	0,79
<b>Japan insgesamt</b>		<b>986.200</b>	<b>0,79</b>

## L&amp;G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,87 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Jersey (30. Juni 2021: 0,74 %)</b>			
25.197	Novocure Ltd	1.751.193	1,40
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>1.751.193</b>	<b>1,40</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 1,19 %)</b>			
17.060	Eurofins Scientific SE	1.339.084	1,07
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>1.339.084</b>	<b>1,07</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 1,02 %)</b>			
69.012	Koninklijke Philips NV	1.483.019	1,18
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>1.483.019</b>	<b>1,18</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: – %)</b>			
70.285	Grifols SA	1.325.206	1,06
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>1.325.206</b>	<b>1,06</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 3,67 %)</b>			
3.005	Lonza Group AG	1.597.692	1,28
4.796	Roche Holding AG	1.595.834	1,27
5.600	Tecan Group AG	1.621.482	1,30
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>4.815.008</b>	<b>3,85</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 1,62 %)</b>			
62.736	EMIS Group Plc	1.420.179	1,13
87.933	Smith & Nephew Plc	1.225.420	0,98
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>2.645.599</b>	<b>2,11</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 79,84 %)</b>			
115.233	3D Systems Corp	1.117.761	0,89
11.211	Abbott Laboratories	1.218.076	0,97
7.665	ABIOMED Inc	1.897.166	1,52

## L&amp;G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,87 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 79,84 %) (Fortsetzung)</b>			
12.533	Agilent Technologies Inc	1.488.546	1,19
5.952	Align Technology Inc	1.408.661	1,13
15.287	Alnylam Pharmaceuticals Inc	2.229.611	1,78
57.673	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	2.030.668	1,62
43.317	Avanos Medical Inc	1.184.288	0,95
108.675	Axogen Inc	890.049	0,71
26.405	Azenta Inc	1.903.802	1,52
17.599	Baxter International Inc	1.130.385	0,90
4.382	Becton Dickinson and Co	1.080.296	0,86
17.642	BioMarin Pharmaceutical Inc	1.461.994	1,17
3.228	Bio-Rad Laboratories Inc	1.597.861	1,28
50.375	Boston Scientific Corp	1.877.478	1,50
16.529	Bristol-Myers Squibb Co	1.272.734	1,02
378.789	Butterfly Network Inc	1.162.883	0,93
72.855	CareDx Inc	1.564.927	1,25
16.780	Catalent Inc	1.800.328	1,44
234.758	Cerus Corp	1.241.871	0,99
8.274	Charles River Laboratories International Inc	1.770.389	1,41
150.688	Codexis Inc	1.576.198	1,26
11.223	CONMED Corp	1.074.715	0,86
7.373	Danaher Corp	1.869.204	1,49
27.467	Dexcom Inc	2.047.117	1,63
87.779	Editas Medicine Inc - Class A	1.038.426	0,83
15.276	Edwards Lifesciences Corp	1.452.596	1,16
32.134	Exact Sciences Corp	1.265.759	1,01
42.505	Fate Therapeutics Inc	1.053.275	0,84
35.400	Fulgent Genetics Inc	1.930.364	1,54
46.886	Glaukos Corp	2.129.564	1,70
16.614	Globus Medical Inc	932.711	0,74
48.637	Guardant Health Inc	1.962.018	1,57

## L&amp;G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,87 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 79,84 %) (Fortsetzung)</b>			
127.007	Health Catalyst Inc	1.840.333	1,47
20.291	Hologic Inc	1.406.167	1,12
8.629	Illumina Inc	1.590.844	1,27
25.009	Incyte Corp	1.899.935	1,52
9.457	Insulet Corp	2.061.060	1,65
33.132	Integra LifeSciences Holdings Corp	1.790.123	1,43
9.230	Intuitive Surgical Inc	1.852.555	1,48
8.337	IQVIA Holdings Inc	1.809.047	1,44
13.453	iRhythm Technologies Inc	1.453.329	1,16
9.549	Masimo Corp	1.247.769	1,00
11.029	Medpace Holdings Inc	1.650.712	1,32
13.486	Moderna Inc	1.926.477	1,54
97.821	NanoString Technologies Inc	1.242.328	0,99
54.367	Natera Inc	1.926.768	1,54
36.326	Nevro Corp	1.592.170	1,27
16.671	Omniceil Inc	1.896.328	1,51
13.689	Penumbra Inc	1.704.556	1,36
11.231	PerkinElmer Inc	1.597.274	1,28
18.664	QuidelOrtho Corp	1.813.769	1,45
2.934	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.734.377	1,39
30.784	STAAR Surgical Co	2.183.511	1,74
7.039	Stryker Corp	1.400.269	1,12
153.104	Tactile Systems Technology Inc	1.117.660	0,89
58.224	Teladoc Health Inc	1.933.621	1,54
3.602	Thermo Fisher Scientific Inc	1.956.896	1,56
66.004	Twist Bioscience Corp	2.307.502	1,84
10.268	Veeva Systems Inc - Class A	2.033.476	1,62
108.041	Veracyte Inc	2.150.018	1,72
5.596	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.576.898	1,26
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>100.357.493</b>	<b>80,14</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>125.029.978</b>	<b>99,85</b>

**L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2022

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	125.029.978	99,85
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	191.059	0,15
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>125.221.037</b>	<b>100,00</b>

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	98,85
Sonstige Vermögenswerte	1,15
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %)</b>			
<b>Österreich (30. Juni 2021: 0,41 %)</b>			
3.505	ams-OSRAM AG	30.110	0,03
848	BAWAG Group AG '144A'	34.056	0,04
3.828	Erste Group Bank AG	92.637	0,10
1.737	Raiffeisen Bank International AG	17.960	0,02
899	Verbund AG	83.922	0,09
1.458	Wienerberger AG	29.860	0,03
<b>Österreich insgesamt</b>		<b>288.545</b>	<b>0,31</b>
<b>Belgien (30. Juni 2021: 1,55 %)</b>			
284	Ackermans & van Haaren NV	40.470	0,04
481	Aedifica SA (REIT)	44.011	0,05
1.949	Ageas SA/NV	81.819	0,09
10.737	Anheuser-Busch InBev SA/NV	551.452	0,60
363	Cofinimmo SA (REIT)	37.607	0,04
286	D'iereeren Group	39.926	0,04
385	Elia Group SA/NV	52.052	0,06
1.232	Groupe Bruxelles Lambert SA	98.166	0,11
3.144	KBC Group NV	168.330	0,18
1.603	Proximus SADP	22.546	0,02
192	Sofina SA	37.440	0,04
1.359	UCB SA	109.590	0,12
1.828	Warehouses De Pauw CVA (REIT)	54.840	0,06
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>1.338.249</b>	<b>1,45</b>
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 0,05 %)</b>			
12.626	AutoStore Holdings Ltd '144A'	17.114	0,02
4.490	Hiscox Ltd	49.154	0,05
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>66.268</b>	<b>0,07</b>

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 3,92 %)</b>			
1.900	ALK-Abello A/S	31.476	0,03
2.254	Ambu A/S - Class B	20.889	0,02
78	AP Moller - Maersk A/S - Class B	173.638	0,19
1.227	Carlsberg AS	149.154	0,16
1.053	Chr Hansen Holding A/S	73.148	0,08
1.537	Coloplast A/S	167.079	0,18
7.647	Danske Bank A/S	103.137	0,11
1.298	Demant A/S	46.480	0,05
2.659	DSV A/S	354.406	0,39
817	Genmab A/S	252.351	0,27
1.672	GN Store Nord AS	55.916	0,06
2.032	ISS A/S	30.576	0,03
577	Netcompany Group A/S '144A'	30.089	0,03
19.623	Novo Nordisk A/S	2.077.172	2,26
2.321	Novozymes A/S	132.956	0,15
1.070	Pandora A/S	64.243	0,07
330	Ringkjoebing Landbobank A/S	34.302	0,04
142	ROCKWOOL A/S	30.504	0,03
461	Royal Unibrew A/S	38.955	0,04
512	SimCorp A/S	35.471	0,04
5.438	Tryg A/S	116.523	0,13
11.769	Vestas Wind Systems A/S	237.226	0,26
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>4.255.691</b>	<b>4,62</b>
<b>Färöer-Inseln (30. Juni 2021: 0,03 %)</b>			
656	Bakkafrost P/F	40.013	0,04
<b>Färöer Inseln insgesamt</b>		<b>40.013</b>	<b>0,04</b>
<b>Finnland (30. Juni 2021: 2,19 %)</b>			
1.677	Elisa Oyj	89.921	0,10

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Finnland (30. Juni 2021: 2,19 %) (Fortsetzung)</b>			
1.325	Huhtamaki Oyj	50.085	0,06
3.019	Kesko Oyj	67.958	0,07
1.355	Kojamo Oyj	22.303	0,02
3.937	Kone Oyj - Class B	178.582	0,19
9.152	Metso Outotec Oyj	65.437	0,07
69.290	Nokia Oyj	307.613	0,33
43.685	Nordea Bank Abp	366.779	0,40
1.286	Orion Oyj	54.784	0,06
6.470	Sampo Oyj - Class A	268.634	0,29
7.225	Stora Enso Oyj	108.122	0,12
6.502	UPM-Kymmene Oyj	188.623	0,21
1.680	Valmet Oyj	39.329	0,04
5.993	Wartsila OYJ Abp	44.528	0,05
	<b>Finnland insgesamt</b>	<b>1.852.698</b>	<b>2,01</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 15,44 %)</b>			
2.537	Accor SA	65.531	0,07
351	Aeroports de Paris	42.418	0,05
6.700	Air Liquide SA	858.404	0,93
4.184	Alstom SA	90.333	0,10
344	Alten SA	35.707	0,04
780	Amundi SA '144A'	40.716	0,04
1.316	Atos SE	16.825	0,02
28.091	AXA SA	608.451	0,66
551	BioMerieux	51.353	0,06
14.078	BNP Paribas SA	638.648	0,69
11.528	Bolloré SE	50.954	0,05
2.511	Bouygues SA	73.723	0,08
3.702	Bureau Veritas SA	90.514	0,10
1.948	Capgemini SE	318.401	0,35

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 15,44 %) (Fortsetzung)</b>			
7.266	Carrefour SA	122.686	0,13
91	Christian Dior SE	51.506	0,06
6.173	Cie de Saint-Gobain	252.753	0,27
7.544	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	195.955	0,21
1.304	Covivio (REIT)	69.047	0,07
15.381	Credit Agricole SA	134.292	0,15
8.430	Danone SA	448.982	0,49
9.363	Dassault Systemes SE	328.782	0,36
2.766	Edenred	124.387	0,13
931	Eiffage SA	79.954	0,09
7.056	Electricite de France SA	55.079	0,06
2.752	Elis SA	34.950	0,04
3.815	EssilorLuxottica SA	545.164	0,59
458	Eurazeo SE	27.068	0,03
678	Gecina SA (REIT)	60.342	0,07
5.496	Getlink SE	92.498	0,10
445	Hermes International	474.815	0,52
457	Ipsen SA	41.153	0,04
852	Kering SA	417.565	0,45
1.860	Klepierre SA (REIT)	34.150	0,04
1.160	La Francaise des Jeux SAEM '144A'	38.303	0,04
3.177	Legrand SA	223.851	0,24
2.825	L'Oreal SA	930.272	1,01
3.404	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1.980.107	2,15
26.137	Orange SA	293.257	0,32
2.686	Pernod Ricard SA	470.856	0,51
3.583	Publicis Groupe SA	167.183	0,18
271	Remy Cointreau SA	45.176	0,05
2.012	Renault SA	47.865	0,05
3.187	Rexel SA	46.769	0,05

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 15,44 %) (Fortsetzung)</b>			
14.216	Sanofi	1.369.569	1,49
273	Sartorius Stedim Biotech	81.709	0,09
6.770	Schneider Electric SE	764.333	0,83
2.060	SCOR SE	42.230	0,05
363	SEB SA	33.233	0,04
8.904	Societe Generale SA	186.005	0,20
1.072	Sodexo SA	71.888	0,08
359	SOITEC	48.645	0,05
192	Sopra Steria Group SACA	27.379	0,03
1.771	SPIE SA	36.660	0,04
705	Teleperformance	206.776	0,22
1.419	Ubisoft Entertainment SA	59.456	0,06
8.061	Veolia Environnement SA	187.741	0,20
6.794	Vinci SA	577.218	0,63
7.493	Vivendi SE	72.652	0,08
327	Wendel SE	26.078	0,03
2.907	Worldline SA/France '144A'	102.850	0,11
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>14.711.167</b>	<b>15,97</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 14,71 %)</b>			
2.249	adidas AG	379.541	0,41
1.864	AIXTRON SE	45.072	0,05
5.350	Allianz SE	974.342	1,06
4.297	Bayerische Motoren Werke AG	315.658	0,34
1.103	Bechtle AG	43.028	0,05
1.053	Beiersdorf AG	102.646	0,11
1.894	Brenntag SE	117.617	0,13
479	Carl Zeiss Meditec AG	54.558	0,06
12.833	Commerzbank AG	85.801	0,09
769	CTS Eventim AG & Co KGaA	38.450	0,04

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 14,71 %) (Fortsetzung)</b>			
5.447	Daimler Truck Holding AG	135.685	0,15
1.965	Delivery Hero SE '144A'	70.288	0,08
27.795	Deutsche Bank AG	231.199	0,25
2.167	Deutsche Boerse AG	345.853	0,37
11.294	Deutsche Lufthansa AG	62.840	0,07
12.793	Deutsche Post AG	457.222	0,50
42.790	Deutsche Telekom AG	810.699	0,88
1.917	Evotec SE	44.091	0,05
1.310	Freenet AG	31.008	0,03
2.387	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	113.693	0,12
5.073	Fresenius SE & Co KGaA	146.610	0,16
2.085	GEA Group AG	68.576	0,07
638	Hannover Rueck SE	88.363	0,10
2.113	HelloFresh SE	65.186	0,07
825	HUGO BOSS AG	41.547	0,04
17.645	Infineon Technologies AG	407.423	0,44
931	KION Group AG	36.858	0,04
637	Knorr-Bremse AG	34.666	0,04
1.248	LEG Immobilien SE	98.742	0,11
1.542	Merck KGaA	248.262	0,27
750	MTU Aero Engines AG	130.275	0,14
1.710	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	383.382	0,42
735	Nemetschek SE	42.454	0,05
2.134	ProSiebenSat.1 Media SE	18.801	0,02
830	Puma SE	52.157	0,06
62	Rational AG	34.379	0,04
12.922	SAP SE	1.123.309	1,22
757	Scout24 SE '144A'	37.085	0,04
9.149	Siemens AG	888.276	0,96
3.381	Siemens Healthineers AG '144A'	163.945	0,18

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 14,71 %) (Fortsetzung)</b>			
1.566	Symrise AG - Class A	162.629	0,18
1.816	TAG Immobilien AG	19.776	0,02
18.585	Telefonica Deutschland Holding AG	50.923	0,05
1.100	United Internet AG	29.953	0,03
545	Vantage Towers AG	14.497	0,01
10.311	Vonovia SE	303.143	0,33
2.600	Zalando SE '144A'	64.896	0,07
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>9.215.404</b>	<b>10,00</b>
<b>International (30. Juni 2021: – %)</b>			
1.485	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	72.245	0,08
<b>International insgesamt</b>		<b>72.245</b>	<b>0,08</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 2,70 %)</b>			
12.515	Bank of Ireland Group Plc	75.491	0,08
2.068	Flutter Entertainment Plc	199.521	0,22
2.999	Grafton Group Plc	27.062	0,03
1.812	Kerry Group Plc	165.508	0,18
1.901	Kingspan Group Plc	109.117	0,12
6.421	Linde Plc	1.759.033	1,91
15.932	Ryanair Holdings Plc	179.633	0,19
3.248	Smurfit Kappa Group Plc	104.196	0,11
<b>Irland insgesamt</b>		<b>2.619.561</b>	<b>2,84</b>
<b>Isle of Man (30. Juni 2021: 0,14 %)</b>			
6.758	Entain Plc	97.738	0,11
<b>Isle of Man insgesamt</b>		<b>97.738</b>	<b>0,11</b>
<b>Italien (30. Juni 2021: 2,83 %)</b>			
1.635	Amplifon SpA	47.824	0,05

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Italien (30. Juni 2021: 2,83 %) (Fortsetzung)</b>			
13.222	Assicurazioni Generali SpA	201.305	0,22
5.357	Atlantia SpA	119.890	0,13
18.024	Banco BPM SpA	48.953	0,05
300	DiaSorin SpA	37.560	0,04
105.081	Enel SpA	548.523	0,60
10.208	FinecoBank Banca Fineco SpA	116.575	0,13
3.617	Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A'	35.027	0,04
877	Interpump Group SpA	31.905	0,03
207.064	Intesa Sanpaolo SpA	368.574	0,40
7.099	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	58.623	0,06
2.453	Moncler SpA	100.401	0,11
9.551	Nexi SpA '144A'	75.491	0,08
4.759	Poste Italiane SpA '144A'	42.412	0,05
3.408	Prysmian SpA	89.324	0,10
1.263	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	52.427	0,06
297	Reply SpA	34.363	0,04
125.025	Telecom Italia SpA/Milano	31.219	0,03
16.510	Terna - Rete Elettrica Nazionale	123.627	0,13
25.569	UniCredit SpA	231.783	0,25
	<b>Italien insgesamt</b>	<b>2.395.806</b>	<b>2,60</b>
<b>Jersey (30. Juni 2021: 0,94 %)</b>			
12.192	Experian Plc	340.758	0,37
2.944	Ferguson Plc	314.220	0,34
9.639	IWG Plc	20.950	0,03
18.132	Man Group Plc/Jersey	52.615	0,06
934	Wizz Air Holdings Plc '144A'	19.031	0,02
13.726	WPP Plc	131.481	0,14
	<b>Jersey insgesamt</b>	<b>879.055</b>	<b>0,96</b>

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 0,50 %)</b>			
4.902	Allegro.eu SA '144A'	24.869	0,03
15.695	Aroundtown SA	47.603	0,05
11.834	B&M European Value Retail SA	50.410	0,05
1.535	Eurofins Scientific SE	115.248	0,12
1.216	Millicom International Cellular SA SDR	16.572	0,02
1.680	SES SA Receipt - Class A	14.014	0,02
	<b>Luxemburg insgesamt</b>	<b>268.716</b>	<b>0,29</b>
<b>Malta (30. Juni 2021: 0,03 %)</b>			
2.799	Kindred Group Plc SDR	22.223	0,02
	<b>Malta insgesamt</b>	<b>22.223</b>	<b>0,02</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 8,61 %)</b>			
1.141	Aalberts NV	42.434	0,05
5.737	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A'	61.472	0,07
343	Adyen NV '144A'	476.084	0,52
20.855	Aegon NV	86.089	0,09
2.119	Akzo Nobel NV	132.692	0,14
922	Arcadis NV	29.596	0,03
602	Argenx SE	215.215	0,23
525	ASM International NV	125.265	0,14
5.162	ASML Holding NV	2.353.098	2,55
1.735	ASR Nederland NV	66.919	0,07
1.009	BE Semiconductor Industries NV	46.283	0,05
12.133	CNH Industrial NV	133.706	0,15
6.672	Davide Campari-Milano NV	66.953	0,07
1.033	Euronext NV '144A'	80.471	0,09
1.688	EXOR NV	100.402	0,11
1.481	Ferrari NV	259.471	0,28
1.326	Heineken Holding NV	92.091	0,10

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 8,61 %) (Fortsetzung)</b>			
3.162	Heineken NV	275.094	0,30
582	IMCD NV	76.213	0,08
49.129	ING Groep NV	463.335	0,50
993	JDE Peet's NV	26.970	0,03
2.385	Just Eat Takeaway.com NV '144A'	35.932	0,04
12.666	Koninklijke Ahold Delhaize NV	314.877	0,34
1.928	Koninklijke DSM NV	264.329	0,29
37.972	Koninklijke KPN NV	129.143	0,14
10.178	Koninklijke Philips NV	209.209	0,23
3.585	NN Group NV	155.374	0,17
10.135	Prosus NV	633.235	0,69
2.619	QIAGEN NV	117.069	0,13
1.615	Randstad NV	74.613	0,08
1.587	Signify NV '144A'	50.197	0,05
9.122	STMicroelectronics NV	273.523	0,30
9.463	Universal Music Group NV	181.065	0,20
3.009	Wolters Kluwer NV	278.513	0,30
	<b>Niederlande insgesamt</b>	<b>7.926.932</b>	<b>8,61</b>
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 0,96 %)</b>			
2.080	Adevinta ASA	14.328	0,02
13.153	DNB Bank ASA	224.825	0,24
2.339	Gjensidige Forsikring ASA	45.178	0,05
5.131	Mowi ASA	111.326	0,12
2.204	Nordic Semiconductor ASA	32.605	0,04
11.977	Orkla ASA	91.282	0,10
720	Salmar ASA	48.273	0,05
6.117	Storebrand ASA	41.515	0,04
6.329	Telenor ASA	80.271	0,09

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 0,96 %) (Fortsetzung)</b>			
3.902	TOMRA Systems ASA	69.013	0,07
<b>Norwegen insgesamt</b>		<b>758.616</b>	<b>0,82</b>
<b>Polen (30. Juni 2021: 0,29 %)</b>			
2.311	Bank Polska Kasa Opieki SA	40.092	0,04
644	Dino Polska SA '144A'	43.708	0,05
1.531	KGHM Polska Miedz SA	38.730	0,04
14	LPP SA	26.793	0,03
11.362	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	67.686	0,07
7.822	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	49.892	0,06
<b>Polen insgesamt</b>		<b>266.901</b>	<b>0,29</b>
<b>Portugal (30. Juni 2021: 0,18 %)</b>			
32.067	EDP - Energias de Portugal SA	142.762	0,16
2.861	Jeronimo Martins SGPS SA	59.337	0,06
<b>Portugal insgesamt</b>		<b>202.099</b>	<b>0,22</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: 3,97 %)</b>			
313	Acciona SA	54.931	0,06
2.227	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	51.511	0,05
839	Aena SME SA '144A'	101.729	0,11
6.023	Amadeus IT Group SA	320.183	0,35
86.676	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	375.350	0,41
75.296	Banco de Sabadell SA	57.270	0,06
218.099	Banco Santander SA	586.250	0,64
7.826	Bankinter SA	46.580	0,05
54.414	CaixaBank SA	180.491	0,20
6.921	Cellnex Telecom SA '144A'	256.285	0,28
2.778	EDP Renovaveis SA	62.561	0,07
5.466	Ferrovial SA	132.223	0,14

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien (30. Juni 2021: 3,97 %) (Fortsetzung)</b>			
922	Fluidra SA	17.831	0,02
3.136	Grifols SA	56.558	0,06
80.089	Iberdrola SA	792.561	0,86
12.236	Industria de Diseno Textil SA	264.175	0,29
3.116	Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT)	19.023	0,02
49.487	International Consolidated Airlines Group SA	61.867	0,07
4.133	Merlin Properties Socimi SA (REIT)	38.044	0,04
4.790	Red Electrica Corp SA	86.340	0,09
2.986	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	53.479	0,06
62.698	Telefonica SA	304.838	0,33
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>3.920.080</b>	<b>4,26</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 5,89 %)</b>			
2.099	AAK AB	32.700	0,04
1.437	AddLife AB - Class B	20.603	0,02
3.244	AddTech AB	40.394	0,04
13.099	Assa Abloy AB	265.693	0,29
22.796	Atlas Copco AB	203.359	0,22
1.721	Avanza Bank Holding AB	27.574	0,03
2.060	Axfood AB	56.590	0,06
4.815	Beijer Ref AB - Class B	62.878	0,07
2.512	BillerudKorsnas AB	27.985	0,03
3.041	Boliden AB	92.353	0,10
2.791	Castellum AB	34.245	0,04
4.184	Dometic Group AB '144A'	23.433	0,02
4.694	Elekta AB	30.960	0,03
7.363	Epiroc AB	108.557	0,12
4.163	EQT AB	81.370	0,09
7.343	Essity AB	183.075	0,20
1.992	Evolution AB '144A'	172.942	0,19

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (30. Juni 2021: 5,89 %) (Fortsetzung)</b>			
7.963	Fabege AB	71.787	0,08
8.448	Fastighets AB Balder - Class B	38.647	0,04
2.907	Getinge AB	64.147	0,07
8.955	H & M Hennes & Mauritz AB	102.112	0,11
25.228	Hexagon AB	250.204	0,27
3.273	Hexpol AB	26.595	0,03
1.235	Holmen AB	47.829	0,05
5.409	Husqvarna AB	37.988	0,04
999	Industrivarden AB - Class A	21.466	0,02
3.578	Indutrade AB	62.304	0,07
1.820	Investment AB Latour	34.368	0,04
26.323	Investor AB	413.230	0,45
3.251	Kinnevik AB	50.010	0,05
965	L E Lundbergforetagen AB	37.463	0,04
2.981	Lifco AB	45.703	0,05
17.742	Nibe Industrier AB	127.188	0,14
2.060	Sagax AB	36.284	0,04
12.015	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	19.105	0,02
15.030	Sandvik AB	232.679	0,25
910	Sectra AB	11.671	0,01
3.653	Securitas AB	30.047	0,03
3.981	Sinch AB '144A'	12.372	0,01
19.598	Skandinaviska Enskilda Banken AB - Class A	183.665	0,20
4.233	Skanska AB	61.955	0,07
3.981	SKF AB	55.926	0,06
16.441	Storskogen Group AB	22.206	0,02
6.817	Svenska Cellulosa AB SCA - Class B	97.230	0,11
19.091	Svenska Handelsbanken AB - Class A	155.784	0,17
2.719	Sweco AB	26.979	0,03
11.472	Swedbank AB	138.459	0,15

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (30. Juni 2021: 5,89 %) (Fortsetzung)</b>			
2.362	Swedish Orphan Biovitrum AB	48.769	0,05
4.775	Tele2 AB	51.926	0,06
35.643	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	253.752	0,28
24.967	Telia Co AB	91.309	0,10
1.358	Thule Group AB '144A'	31.855	0,03
3.152	Trelleborg AB	60.638	0,07
1.054	Viaplay Group AB - Class B	20.651	0,02
1.123	Vitrolife AB	24.655	0,03
5.530	Volvo Car AB	35.080	0,04
4.798	Wallenstam AB	20.042	0,02
3.556	Wihlborgs Fastigheter AB	23.749	0,03
	<b>Schweden insgesamt</b>	<b>4.642.540</b>	<b>5,04</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 15,31 %)</b>			
21.775	ABB Ltd	553.915	0,60
2.114	Adecco Group AG	68.519	0,07
6.343	Alcon Inc	422.587	0,46
105	Allreal Holding AG	16.555	0,02
405	Bachem Holding AG	26.849	0,03
528	Baloise Holding AG	82.244	0,09
43	Barry Callebaut AG	91.511	0,10
131	Belimo Holding AG	43.978	0,05
80	Bucher Industries AG	26.537	0,03
1	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	100.014	0,11
6.403	Cie Financiere Richemont SA	650.305	0,71
2.622	Clariant AG	47.627	0,05
2.356	Coca-Cola HBC AG	49.865	0,05
29.668	Credit Suisse Group AG	160.662	0,17
345	DKSH Holding AG	27.163	0,03
995	Dufry AG	30.679	0,03

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 15,31 %) (Fortsetzung)</b>			
89	EMS-Chemie Holding AG	63.180	0,07
234	Flughafen Zurich AG	33.737	0,04
353	Galenica AG '144A'	25.853	0,03
402	Geberit AG	184.279	0,20
1.040	Georg Fischer AG	48.796	0,05
125	Givaudan SA	419.264	0,46
442	Helvetia Holding AG	49.329	0,05
7	Interroll Holding AG	14.967	0,02
2.446	Julius Baer Group Ltd	107.629	0,12
607	Kuehne + Nagel International AG	137.064	0,15
1.928	Logitech International SA	96.067	0,10
975	Lonza Group AG	495.848	0,54
36.256	Nestle SA	4.036.894	4,38
26.337	Novartis AG	2.127.515	2,31
311	Partners Group Holding AG	267.292	0,29
568	PSP Swiss Property AG	60.270	0,07
9.175	Roche Holding AG	2.920.182	3,17
531	Schindler Holding AG	92.368	0,10
95	SGS SA	207.396	0,23
50	Siegfried Holding AG	30.474	0,03
3.234	SIG Group AG	67.920	0,07
1.724	Sika AG	378.954	0,41
627	Sonova Holding AG	190.444	0,21
847	Straumann Holding AG	97.025	0,11
371	Swatch Group AG/The	83.959	0,09
366	Swiss Life Holding AG	170.044	0,18
955	Swiss Prime Site AG	79.913	0,09
3.404	Swiss Re AG	251.611	0,27
302	Swisscom AG	159.138	0,17
168	Tecan Group AG	46.530	0,05

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 15,31 %) (Fortsetzung)</b>			
636	Temenos AG	51.866	0,06
44.625	UBS Group AG	686.188	0,74
311	VAT Group AG '144A'	70.723	0,08
1.940	Zurich Insurance Group AG	804.795	0,87
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>16.956.524</b>	<b>18,41</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 19,19 %)</b>			
11.090	3i Group Plc	142.805	0,16
28.163	abrdn plc	52.296	0,06
2.783	Admiral Group Plc	72.546	0,08
3.836	Allfunds Group Plc	28.233	0,03
3.263	Antofagasta Plc	43.780	0,05
5.427	Ashtead Group Plc	216.804	0,24
4.621	Associated British Foods Plc	84.707	0,09
19.339	AstraZeneca Plc	2.426.236	2,63
12.121	Auto Trader Group Plc '144A'	78.146	0,09
8.079	Avast Plc '144A'	48.520	0,05
1.468	AVEVA Group Plc	38.386	0,04
47.161	Aviva Plc	219.851	0,24
188.721	Barclays Plc	335.682	0,36
13.588	Barratt Developments Plc	72.198	0,08
7.250	Beazley Plc	42.026	0,05
1.663	Bellway Plc	41.457	0,05
933	Berkeley Group Holdings Plc	40.361	0,04
2.298	Big Yellow Group Plc (REIT)	35.023	0,04
7.939	Bridgepoint Group Plc '144A'	22.281	0,02
12.353	British Land Co Plc/The (REIT)	64.158	0,07
3.492	Britvic Plc	32.898	0,04
84.995	BT Group Plc	183.942	0,20
3.836	Bunzl Plc	121.161	0,13

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 19,19 %) (Fortsetzung)</b>			
4.805	Burberry Group Plc	91.596	0,10
1.846	Close Brothers Group Plc	21.980	0,02
22.405	Compass Group Plc	437.250	0,48
20.919	ConvaTec Group Plc '144A'	54.530	0,06
1.613	Croda International Plc	121.269	0,13
1.416	Dechra Pharmaceuticals Plc	56.881	0,06
2.024	Derwent London Plc (REIT)	61.413	0,07
28.896	Diageo Plc	1.185.084	1,29
1.608	Diploma Plc	41.618	0,05
17.710	Direct Line Insurance Group Plc	51.782	0,06
17.918	DS Smith Plc	57.718	0,06
7.380	easyJet Plc	31.429	0,03
1.465	Future Plc	29.322	0,03
411	Games Workshop Group Plc	31.893	0,03
847	Genus Plc	24.677	0,03
60.634	GlaxoSmithKline Plc	1.243.609	1,35
1.248	Greggs Plc	26.211	0,03
4.059	Halma Plc	94.727	0,10
4.377	Hargreaves Lansdown Plc	40.056	0,04
22.151	Hays Plc	28.717	0,03
2.201	Hikma Pharmaceuticals Plc	41.356	0,05
3.792	HomeServe Plc	51.626	0,06
7.940	Howden Joinery Group Plc	55.581	0,06
261.010	HSBC Holdings Plc	1.623.951	1,76
5.450	IG Group Holdings Plc	43.716	0,05
3.409	IMI Plc	46.452	0,05
4.689	Inchcape Plc	37.884	0,04
13.002	Indivior Plc	46.701	0,05
16.901	Informa Plc	103.820	0,11
2.974	InterContinental Hotels Group Plc	150.282	0,16

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 19,19 %) (Fortsetzung)</b>			
3.675	Intermediate Capital Group Plc	55.882	0,06
1.849	Intertek Group Plc	90.340	0,10
8.127	Investec Plc	41.992	0,05
47.192	ITV Plc	35.776	0,04
30.571	J Sainsbury Plc	72.446	0,08
32.345	JD Sports Fashion Plc	43.360	0,05
22.472	Kingfisher Plc	63.774	0,07
9.839	Land Securities Group Plc (REIT)	75.892	0,08
70.622	Legal & General Group Plc	196.481	0,21
906.158	Lloyds Banking Group Plc	445.371	0,48
3.950	London Stock Exchange Group Plc	350.196	0,38
11.006	LondonMetric Property Plc (REIT)	29.201	0,03
29.041	M&G Plc	65.649	0,07
25.741	Marks & Spencer Group Plc	40.517	0,04
9.220	Meggitt Plc	84.505	0,09
5.619	Mondi Plc	94.972	0,10
62.307	NatWest Group Plc	158.003	0,17
1.403	Next Plc	95.506	0,10
2.402	NMC Health Plc*	–	–
4.979	Ocado Group Plc	45.184	0,05
3.641	OSB Group Plc	20.310	0,02
4.964	Oxford Nanopore Technologies Plc	15.944	0,02
8.993	Pearson Plc	78.330	0,09
5.933	Pennon Group Plc	65.647	0,07
4.063	Persimmon Plc	87.930	0,10
11.768	Phoenix Group Holdings Plc	80.709	0,09
16.399	Primary Health Properties Plc (REIT)	25.965	0,03
32.910	Prudential Plc	388.416	0,42
8.910	Reckitt Benckiser Group Plc	638.614	0,69
24.696	RELX Plc	638.597	0,69

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 19,19 %) (Fortsetzung)</b>			
21.597	Rentokil Initial Plc	119.068	0,13
10.718	Rightmove Plc	70.769	0,08
13.115	Royal Mail Plc	41.089	0,04
6.066	RS GROUP Plc	61.235	0,07
1.988	Safestore Holdings Plc (REIT)	24.502	0,03
10.302	Sage Group Plc/The	75.969	0,08
1.526	Schroders Plc	47.366	0,05
14.365	Segro Plc (REIT)	163.000	0,18
2.973	Severn Trent Plc	93.903	0,10
10.064	Smith & Nephew Plc	134.152	0,15
6.193	Smiths Group Plc	100.681	0,11
1.678	Softcat Plc	25.672	0,03
1.470	Spectris Plc	46.294	0,05
819	Spirax-Sarco Engineering Plc	93.978	0,10
12.724	SSE Plc	238.858	0,26
6.903	St James's Place Plc	88.408	0,10
33.852	Standard Chartered Plc	243.259	0,26
4.656	Tate & Lyle Plc	40.532	0,04
48.530	Taylor Wimpey Plc	65.761	0,07
90.889	Tesco Plc	269.760	0,29
2.986	Travis Perkins Plc	33.563	0,04
16.006	Tritax Big Box REIT Plc (REIT)	33.747	0,04
32.262	Unilever Plc	1.394.525	1,51
5.347	UNITE Group Plc/The (REIT)	66.089	0,07
6.923	United Utilities Group Plc	82.029	0,09
1.055	Victrex Plc	21.802	0,02
16.169	Virgin Money UK Plc	24.558	0,03
3.030	Vistry Group Plc	29.426	0,03
350.567	Vodafone Group Plc	515.805	0,56
3.239	Watches of Switzerland Group Plc '144A'	28.934	0,03

## L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 19,19 %) (Fortsetzung)</b>			
3.438	Weir Group Plc/The	54.435	0,06
2.708	Whitbread Plc	77.952	0,08
8.099	Wise Plc - Class A	27.980	0,03
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>18.937.238</b>	<b>20,56</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>91.734.309</b>	<b>99,58</b>
<b>Vorzugsaktien (3. Juni 2021: – %)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: – %)</b>			
1.967	Henkel AG & Co KGaA - Preference	115.620	0,13
288	Sartorius AG - Preference	96.019	0,10
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>211.639</b>	<b>0,23</b>
	<b>Vorzugsaktien Insgesamt</b>	<b>211.639</b>	<b>0,23</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	91.734.309	99,58
	Vorzugsaktien	211.639	0,23
	<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>175.715</b>	<b>0,19</b>
		<b>92.121.663</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,80
	Sonstige Vermögenswerte		0,20
			<b>100,00</b>
	Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

\*Dieses Wertpapier wird mit null bewertet.

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %)</b>			
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 0,17 %)</b>			
8.965	Arch Capital Group Ltd	407.818	0,05
4.871	Bunge Ltd	441.751	0,05
<b>Bermuda insgesamt</b>		849.569	0,10
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,27 %)</b>			
10.876	GLOBALFOUNDRIES Inc	438.738	0,05
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		438.738	0,05
<b>Irland (30. Juni 2021: 2,25 %)</b>			
15.404	Accenture Plc - Class A	4.276.921	0,50
5.386	Aon Plc	1.452.496	0,17
12.668	Eaton Corp Plc	1.596.041	0,19
5.421	Horizon Therapeutics Plc	432.379	0,05
23.588	Johnson Controls International plc	1.129.393	0,13
16.827	Linde Plc	4.838.267	0,56
46.129	Medtronic Plc	4.140.078	0,48
7.718	Seagate Technology Holdings Plc	551.374	0,06
3.311	STERIS Plc	682.563	0,08
7.909	Trane Technologies Plc	1.027.142	0,12
2.932	Willis Towers Watson Plc	578.748	0,07
<b>Irland insgesamt</b>		20.705.402	2,41
<b>Jersey (30. Juni 2021: 0,22 %)</b>			
52.009	Amcor Plc	646.472	0,08
8.842	Aptiv Plc	787.557	0,09
<b>Jersey insgesamt</b>		1.434.029	0,17

## L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Liberia (30. Juni 2021: 0,05 %)</b>			
5.827	Royal Caribbean Cruises Ltd	203.420	0,02
<b>Liberia insgesamt</b>		<b>203.420</b>	<b>0,02</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 0,10 %)</b>			
2.895	Spotify Technology SA	271.638	0,03
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>271.638</b>	<b>0,03</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 0,38 %)</b>			
10.447	Chubb Ltd	2.053.671	0,24
4.917	Garmin Ltd	483.095	0,06
10.762	TE Connectivity Ltd	1.217.721	0,14
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>3.754.487</b>	<b>0,44</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 0,13 %)</b>			
3.101	Atlassian Corp Plc	581.127	0,07
11.499	Royalty Pharma Plc - Class A	483.418	0,05
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>1.064.545</b>	<b>0,12</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %)</b>			
13.705	3M Co	1.773.564	0,21
59.167	Abbott Laboratories	6.428.495	0,75
42.925	AbbVie Inc	6.574.393	0,76
17.514	Activision Blizzard Inc	1.363.640	0,16
11.222	Adobe Inc	4.107.925	0,48
54.735	Advanced Micro Devices Inc	4.185.585	0,49
14.623	Aflac Inc	809.091	0,09
9.893	Agilent Technologies Inc	1.174.992	0,14
6.976	Air Products & Chemicals Inc	1.677.588	0,20
8.096	Airbnb Inc	721.192	0,08
3.794	Akamai Technologies Inc	346.506	0,04

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
3.868	Albemarle Corp	808.335	0,09
3.676	Albertsons Cos Inc	98.223	0,01
5.594	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	811.298	0,09
2.478	Align Technology Inc	586.468	0,07
7.096	Allstate Corp/The	899.276	0,10
8.720	Ally Financial Inc	292.207	0,03
2.608	Alnylam Pharmaceuticals Inc	380.377	0,04
6.164	Alphabet Inc	13.483.442	1,57
7.659	Alphabet Inc - Class A	16.690.952	1,94
306.146	Amazon.com Inc	32.515.767	3,78
16.117	American Express Co	2.234.139	0,26
20.501	American International Group Inc	1.048.216	0,12
14.644	American Tower Corp (REIT)	3.742.860	0,44
6.303	American Water Works Co Inc	937.697	0,11
2.732	Ameriprise Financial Inc	649.342	0,08
5.214	AmerisourceBergen Corp - Class A	737.677	0,09
7.414	AMETEK Inc	814.724	0,09
14.081	Amgen Inc	3.425.907	0,40
19.455	Amphenol Corp - Class A	1.252.513	0,15
17.628	Analog Devices Inc	2.575.275	0,30
2.035	ANSYS Inc	486.955	0,06
7.938	Apollo Global Management Inc	384.834	0,04
567.175	Apple Inc	77.544.166	9,02
31.401	Applied Materials Inc	2.856.863	0,33
18.710	Archer-Daniels-Midland Co	1.451.896	0,17
8.217	Arista Networks Inc	770.262	0,09
5.072	Arthur J Gallagher & Co	826.939	0,10
175.345	AT&T Inc	3.675.231	0,43
5.564	Autodesk Inc	956.785	0,11
10.391	Automatic Data Processing Inc	2.182.526	0,25

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
678	AutoZone Inc	1.457.103	0,17
4.846	AvalonBay Communities Inc (REIT)	941.335	0,11
18.863	Avantor Inc	586.639	0,07
2.766	Avery Dennison Corp	447.732	0,05
10.811	Ball Corp	743.472	0,09
180.706	Bank of America Corp	5.625.378	0,65
20.324	Bank of New York Mellon Corp/The	847.714	0,10
17.074	Baxter International Inc	1.096.663	0,13
9.519	Becton Dickinson and Co	2.346.719	0,27
32.280	Berkshire Hathaway Inc - Class B	8.813.086	1,02
7.153	Best Buy Co Inc	466.304	0,05
3.454	Biogen Inc	704.409	0,08
718	Bio-Rad Laboratories Inc	355.410	0,04
1.306	Bio-Techne Corp	452.712	0,05
3.434	BlackRock Inc	2.091.443	0,24
17.435	Blackstone Inc	1.590.595	0,18
13.466	Block Inc	827.620	0,10
974	Booking Holdings Inc	1.703.516	0,20
5.133	Boston Properties Inc (REIT)	456.734	0,05
49.387	Boston Scientific Corp	1.840.653	0,21
70.504	Bristol-Myers Squibb Co	5.428.808	0,63
13.802	Broadcom Inc	6.705.150	0,78
2.820	Broadridge Financial Solutions Inc	401.991	0,05
5.667	Brown & Brown Inc	330.613	0,04
5.182	Brown-Forman Corp	363.569	0,04
5.828	Brown-Forman Corp	394.206	0,05
6.454	Cadence Design Systems Inc	968.294	0,11
3.717	Camden Property Trust (REIT)	499.862	0,06
6.438	Campbell Soup Co	309.346	0,04
10.405	Capital One Financial Corp	1.084.097	0,13

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
10.044	Cardinal Health Inc	525.000	0,06
5.251	CarMax Inc	475.110	0,06
28.659	Carrier Global Corp	1.021.980	0,12
5.289	Catalent Inc	567.457	0,07
17.225	Caterpillar Inc	3.079.141	0,36
11.960	CBRE Group Inc - Class A	880.376	0,10
4.363	CDW Corp/DE	687.434	0,08
3.555	Celanese Corp - Class A	418.104	0,05
14.083	Centene Corp	1.191.563	0,14
7.453	CF Industries Holdings Inc	638.946	0,07
39.670	Charles Schwab Corp/The	2.506.351	0,29
2.993	Charter Communications Inc	1.402.310	0,16
671	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	877.171	0,10
7.631	Church & Dwight Co Inc	707.088	0,08
7.932	Cigna Corp	2.090.241	0,24
3.592	Cincinnati Financial Corp	427.376	0,05
2.994	Cintas Corp	1.118.349	0,13
142.601	Cisco Systems Inc	6.080.507	0,71
50.454	Citigroup Inc	2.320.379	0,27
11.992	Citizens Financial Group Inc	427.994	0,05
4.260	Clorox Co/The	600.575	0,07
7.101	Cloudflare Inc	310.669	0,04
8.698	CME Group Inc	1.780.481	0,21
145.725	Coca-Cola Co/The	9.167.560	1,07
13.270	Cognizant Technology Solutions Corp	895.592	0,10
27.971	Colgate-Palmolive Co	2.241.596	0,26
112.748	Comcast Corp	4.424.232	0,51
15.439	Conagra Brands Inc	528.631	0,06
5.144	Constellation Brands Inc - Class A	1.198.861	0,14
11.435	Constellation Energy Corp	654.768	0,08

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
1.641	Cooper Cos Inc/The	513.830	0,06
7.194	Copart Inc	781.700	0,09
25.521	Corning Inc	804.167	0,09
24.562	Corteva Inc	1.329.787	0,15
9.652	CoStar Group Inc	583.077	0,07
14.120	Costco Wholesale Corp	6.767.434	0,79
29.611	Coupang Inc	377.540	0,04
4.621	CrowdStrike Holdings Inc	778.916	0,09
14.908	Crown Castle International Corp (REIT)	2.510.209	0,29
74.667	CSX Corp	2.169.823	0,25
4.458	Cummins Inc	862.757	0,10
33.219	CVS Health Corp	3.078.073	0,36
21.693	Danaher Corp	5.499.609	0,64
3.075	Darden Restaurants Inc	347.844	0,04
5.332	Datadog Inc	507.820	0,06
9.436	Deere & Co	2.825.799	0,33
9.382	Dell Technologies Inc	433.542	0,05
12.247	Dexcom Inc	912.769	0,11
9.733	Digital Realty Trust Inc (REIT)	1.263.635	0,15
7.270	Discover Financial Services	687.597	0,08
4.421	DocuSign Inc - Class A	253.677	0,03
7.047	Dollar General Corp	1.729.616	0,20
7.483	Dollar Tree Inc	1.166.226	0,14
6.589	DoorDash Inc	422.816	0,05
4.611	Dover Corp	559.407	0,06
10.821	DR Horton Inc	716.242	0,08
12.859	Duke Realty Corp (REIT)	706.602	0,08
17.214	DuPont de Nemours Inc	956.754	0,11
4.163	Eastman Chemical Co	373.712	0,04
18.761	eBay Inc	781.771	0,09

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
8.162	Ecolab Inc	1.254.989	0,15
13.162	Edison International	832.365	0,10
21.406	Edwards Lifesciences Corp	2.035.497	0,24
6.454	Electronic Arts Inc	785.129	0,09
5.970	Elevance Health Inc	2.881.003	0,33
26.954	Eli Lilly & Co	8.739.295	1,02
3.954	Enphase Energy Inc	771.979	0,09
4.508	Entegris Inc	415.322	0,05
6.895	Entergy Corp	776.653	0,09
1.389	EPAM Systems Inc	409.449	0,05
3.040	Equifax Inc	555.651	0,06
3.102	Equinix Inc (REIT)	2.038.076	0,24
6.245	Equity LifeStyle Properties Inc (REIT)	440.085	0,05
13.025	Equity Residential (REIT)	940.665	0,11
2.211	Essex Property Trust Inc (REIT)	578.199	0,07
7.418	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	1.889.142	0,22
34.410	Exelon Corp	1.559.461	0,18
3.711	Expedia Group Inc	351.914	0,04
5.665	Expeditors International of Washington Inc	552.111	0,06
4.654	Extra Space Storage Inc (REIT)	791.738	0,09
887	FactSet Research Systems Inc	341.114	0,04
19.297	Fastenal Co	963.306	0,11
8.233	FedEx Corp	1.866.503	0,22
15.162	Fidelity National Information Services Inc	1.389.901	0,16
16.624	Fifth Third Bancorp	558.566	0,06
4.449	First Republic Bank/CA	641.546	0,07
18.197	FirstEnergy Corp	698.583	0,08
15.269	Fiserv Inc	1.358.483	0,16
1.807	FleetCor Technologies Inc	379.669	0,04
4.344	FMC Corp	464.851	0,05

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
136.252	Ford Motor Co	1.516.485	0,18
15.605	Fortinet Inc	882.931	0,10
11.525	Fortive Corp	626.729	0,07
11.200	Fox Corp	360.192	0,04
2.008	Gartner Inc	485.595	0,06
1.836	Generac Holdings Inc	386.625	0,04
20.071	General Mills Inc	1.514.357	0,18
48.901	General Motors Co	1.553.096	0,18
4.541	Genuine Parts Co	603.953	0,07
31.765	Gilead Sciences Inc	1.963.395	0,23
7.142	Global Payments Inc	790.191	0,09
8.281	Goldman Sachs Group Inc/The	2.459.623	0,29
8.112	Hartford Financial Services Group Inc/The	530.768	0,06
5.859	HCA Healthcare Inc	984.664	0,11
20.000	Healthpeak Properties Inc (REIT)	518.200	0,06
2.471	HEICO Corp	323.998	0,04
967	HEICO Corp - Class A	101.902	0,01
4.662	Hershey Co/The	1.003.076	0,12
46.763	Hewlett Packard Enterprise Co	620.077	0,07
6.727	Hilton Worldwide Holdings Inc	749.657	0,09
8.409	Hologic Inc	582.744	0,07
24.769	Home Depot Inc/The	6.793.394	0,79
9.554	Hormel Foods Corp	452.477	0,05
24.582	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	385.446	0,04
12.927	Howmet Aerospace Inc	406.554	0,05
40.159	HP Inc	1.316.412	0,15
1.063	HubSpot Inc	319.591	0,04
3.093	Humana Inc	1.447.740	0,17
33.767	Huntington Bancshares Inc/OH	406.217	0,05
2.462	IDEX Corp	447.173	0,05

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
2.863	IDEXX Laboratories Inc	1.004.140	0,12
9.723	Illinois Tool Works Inc	1.772.017	0,21
5.435	Illumina Inc	1.001.997	0,12
4.475	Incyte Corp	339.966	0,04
12.924	Ingersoll Rand Inc	543.842	0,06
2.190	Insulet Corp	477.289	0,06
148.666	Intel Corp	5.561.595	0,65
13.661	Intercontinental Exchange Inc	1.284.680	0,15
21.974	International Business Machines Corp	3.102.509	0,36
8.503	International Flavors & Fragrances Inc	1.012.877	0,12
12.948	International Paper Co	541.615	0,06
6.549	Intuit Inc	2.524.247	0,29
12.085	Intuitive Surgical Inc	2.425.580	0,28
20.157	Invitation Homes Inc (REIT)	717.186	0,08
6.101	IQVIA Holdings Inc	1.323.856	0,15
10.064	Iron Mountain Inc (REIT)	490.016	0,06
2.817	JB Hunt Transport Services Inc	443.593	0,05
88.923	Johnson & Johnson	15.784.722	1,84
73.216	JPMorgan Chase & Co	8.244.854	0,96
8.136	Kellogg Co	580.422	0,07
23.667	Keurig Dr Pepper Inc	837.575	0,10
22.063	KeyCorp	380.145	0,04
5.825	Keysight Technologies Inc	802.976	0,09
11.377	Kimberly-Clark Corp	1.537.602	0,18
22.387	Kimco Realty Corp (REIT)	442.591	0,05
14.610	KKR & Co Inc	676.297	0,08
5.163	KLA Corp	1.647.410	0,19
25.717	Kraft Heinz Co/The	980.846	0,11
2.365	Laboratory Corp of America Holdings	554.261	0,06
4.839	Lam Research Corp	2.062.140	0,24

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
7.969	Las Vegas Sands Corp	267.679	0,03
11.410	Lennar Corp	669.881	0,08
3.643	Liberty Broadband Corp	421.277	0,05
57	Liberty Media Corp-Liberty Braves	1.368	0,00
5.161	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	327.569	0,04
5.533	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	199.465	0,02
3.730	Live Nation Entertainment Inc	308.023	0,04
9.738	LKQ Corp	478.038	0,06
5.366	Loews Corp	317.989	0,04
15.911	Lowe's Cos Inc	2.779.174	0,32
1.929	LPL Financial Holdings Inc	355.862	0,04
17.716	Lucid Group Inc	304.007	0,04
3.582	Lululemon Athletica Inc	976.489	0,11
4.468	M&T Bank Corp	712.155	0,08
316	Markel Corp	408.667	0,05
6.924	Marriott International Inc/MD	941.733	0,11
12.421	Marsh & McLennan Cos Inc	1.928.360	0,22
2.034	Martin Marietta Materials Inc	608.654	0,07
28.906	Marvell Technology Inc	1.258.278	0,15
21.427	Mastercard Inc	6.759.790	0,79
6.318	Match Group Inc	440.301	0,05
8.395	McCormick & Co Inc/MD	698.884	0,08
18.520	McDonald's Corp	4.572.218	0,53
4.988	McKesson Corp	1.627.135	0,19
1.513	MercadoLibre Inc	963.584	0,11
86.528	Merck & Co Inc	7.888.758	0,92
57.349	Meta Platforms Inc - Class A	9.247.526	1,08
17.125	MetLife Inc	1.075.279	0,12
749	Mettler-Toledo International Inc	860.429	0,10
8.788	MGM Resorts International	254.413	0,03

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
19.196	Microchip Technology Inc	1.114.904	0,13
41.147	Micron Technology Inc	2.274.606	0,26
184.221	Microsoft Corp	47.313.479	5,50
3.981	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	695.361	0,08
9.027	Moderna Inc	1.289.507	0,15
1.428	Molina Healthcare Inc	399.283	0,05
46.803	Mondelez International Inc	2.905.998	0,34
1.322	MongoDB Inc - Class A	343.059	0,04
1.464	Monolithic Power Systems Inc	562.235	0,07
12.265	Monster Beverage Corp	1.136.965	0,13
4.069	Moody's Corp	1.106.646	0,13
35.371	Morgan Stanley	2.690.318	0,31
13.885	Mosaic Co/The	655.789	0,08
5.691	Motorola Solutions Inc	1.192.834	0,14
1.967	MSCI Inc - Class A	810.699	0,09
2.654	Nasdaq Inc	404.841	0,05
7.785	NetApp Inc	507.893	0,06
10.599	Netflix Inc	1.853.447	0,22
27.357	Newmont Corp	1.632.392	0,19
40.831	NIKE Inc	4.172.928	0,49
8.062	Norfolk Southern Corp	1.832.412	0,21
5.053	Northern Trust Corp	487.513	0,06
13.457	NortonLifeLock Inc	295.516	0,03
80.983	NVIDIA Corp	12.276.213	1,43
107	NVR Inc	428.443	0,05
3.355	Old Dominion Freight Line Inc	859.819	0,10
5.175	Omnicom Group Inc	329.182	0,04
13.598	ON Semiconductor Corp	684.115	0,08
42.406	Oracle Corp	2.962.907	0,34
2.212	O'Reilly Automotive Inc	1.397.453	0,16

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
13.659	Otis Worldwide Corp	965.282	0,11
11.345	PACCAR Inc	934.147	0,11
3.209	Packaging Corp of America	441.237	0,05
40.086	Palantir Technologies Inc	363.580	0,04
2.227	Palo Alto Networks Inc	1.100.004	0,13
26	Paramount Global	709	0,00
15.929	Paramount Global - Class B	393.128	0,05
4.194	Parker-Hannifin Corp	1.031.934	0,12
7.748	Paychex Inc	882.265	0,10
1.089	Paycom Software Inc	305.051	0,04
27.807	PayPal Holdings Inc	1.942.041	0,23
46.915	PepsiCo Inc	7.818.854	0,91
4.161	PerkinElmer Inc	591.777	0,07
188.106	Pfizer Inc	9.862.398	1,15
10.632	PNC Financial Services Group Inc/The	1.677.411	0,20
1.249	Pool Corp	438.686	0,05
7.837	PPG Industries Inc	896.083	0,10
6.527	Principal Financial Group Inc	435.938	0,05
82.308	Procter & Gamble Co/The	11.835.067	1,38
14.425	Progressive Corp/The	1.677.195	0,19
25.003	Prologis Inc (REIT)	2.941.603	0,34
9.511	Prudential Financial Inc	910.012	0,11
5.482	Public Storage (REIT)	1.714.057	0,20
38.152	QUALCOMM Inc	4.873.536	0,57
4.274	Quanta Services Inc	535.703	0,06
2.932	Quest Diagnostics Inc	389.897	0,05
4.672	Raymond James Financial Inc	417.724	0,05
19.931	Realty Income Corp (REIT)	1.360.490	0,16
2.875	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.699.499	0,20
23.370	Regions Financial Corp	438.187	0,05

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
7.336	Republic Services Inc - Class A	960.062	0,11
4.646	ResMed Inc	973.941	0,11
16.706	Rivian Automotive Inc	430.012	0,05
7.094	ROBLOX Corp	233.109	0,03
3.833	Rockwell Automation Inc	763.955	0,09
7.652	Rollins Inc	267.208	0,03
2.620	Roper Technologies Inc	1.033.983	0,12
11.751	Ross Stores Inc	825.273	0,10
8.101	S&P Global Inc	2.730.523	0,32
21.766	Salesforce Inc	3.592.261	0,42
3.538	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	1.132.337	0,13
3.138	Seagen Inc	555.238	0,06
4.651	ServiceNow Inc	2.211.644	0,26
8.045	Sherwin-Williams Co/The	1.801.356	0,21
11.706	Simon Property Group Inc (REIT)	1.111.134	0,13
16.855	Sirius XM Holdings Inc	103.321	0,01
5.514	Skyworks Solutions Inc	510.817	0,06
6.173	Snowflake Inc	858.417	0,10
1.605	SolarEdge Technologies Inc	439.256	0,05
20.154	Southwest Airlines Co	727.962	0,08
3.840	Splunk Inc	339.686	0,04
5.440	SS&C Technologies Holdings Inc	315.901	0,04
5.219	Stanley Black & Decker Inc	547.264	0,06
27.479	Starbucks Corp	2.099.121	0,24
9.157	State Street Corp	564.529	0,07
6.966	Steel Dynamics Inc	460.801	0,05
12.142	Stryker Corp	2.415.408	0,28
3.804	Sun Communities Inc (REIT)	606.205	0,07
1.436	SVB Financial Group	567.206	0,07
13.459	Synchrony Financial	371.738	0,04

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
3.664	Synopsys Inc	1.112.757	0,13
17.045	Sysco Corp	1.443.882	0,17
5.481	T Rowe Price Group Inc	622.696	0,07
3.679	Take-Two Interactive Software Inc	450.788	0,05
15.826	Target Corp	2.235.106	0,26
1.511	Teledyne Technologies Inc	566.791	0,07
5.643	Teradyne Inc	505.331	0,06
28.568	Tesla Inc	19.238.263	2,24
32.922	Texas Instruments Inc	5.058.465	0,59
13.451	Thermo Fisher Scientific Inc	7.307.659	0,85
40.293	TJX Cos Inc/The	2.250.364	0,26
14.438	T-Mobile US Inc	1.942.488	0,23
3.506	Tractor Supply Co	679.638	0,08
10.393	Trade Desk Inc/The - Class A	435.363	0,05
1.763	TransDigm Group Inc	946.149	0,11
4.670	TransUnion	373.553	0,04
5.918	Travelers Cos Inc/The	1.000.911	0,12
8.570	Trimble Inc	499.031	0,06
32.670	Truist Financial Corp	1.549.538	0,18
4.374	Twilio Inc - Class A	366.585	0,04
18.524	Twitter Inc	692.612	0,08
910	Tyler Technologies Inc	302.557	0,04
9.944	Tyson Foods Inc - Class A	855.781	0,10
53.032	Uber Technologies Inc	1.085.035	0,13
195	Ubiquiti Inc	48.401	0,01
11.045	UDR Inc (REIT)	508.512	0,06
1.640	Ulta Beauty Inc	632.187	0,07
21.532	Union Pacific Corp	4.592.345	0,53
11.564	United Airlines Holdings Inc	409.597	0,05
24.687	United Parcel Service Inc - Class B	4.506.365	0,52

## L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
2.398	United Rentals Inc	582.498	0,07
22.803	UnitedHealth Group Inc	11.712.305	1,36
36.668	US Bancorp	1.687.461	0,20
2.848	Veeva Systems Inc - Class A	564.018	0,07
14.076	Ventas Inc (REIT)	723.929	0,08
2.398	VeriSign Inc	401.257	0,05
3.922	Verisk Analytics Inc - Class A	678.859	0,08
101.568	Verizon Communications Inc	5.154.576	0,60
6.334	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.784.858	0,21
11.658	VF Corp	514.934	0,06
40.910	Viatis Inc	428.328	0,05
31.063	VICI Properties Inc (REIT)	925.367	0,11
41.247	Visa Inc - Class A	8.121.122	0,94
5.409	VMware Inc	616.518	0,07
4.423	Vulcan Materials Co	628.508	0,07
4.284	W R Berkley Corp	292.426	0,03
24.403	Walgreens Boots Alliance Inc	924.874	0,11
49.697	Walmart Inc	6.042.161	0,70
46.228	Walt Disney Co/The	4.363.923	0,51
60.604	Warner Bros Discovery Inc	813.306	0,09
13.818	Waste Management Inc	2.113.878	0,25
1.922	Waters Corp	636.144	0,07
99.377	Wells Fargo & Co	3.892.597	0,45
15.735	Welltower Inc (REIT)	1.295.777	0,15
2.451	West Pharmaceutical Services Inc	741.109	0,09
10.668	Western Digital Corp	478.246	0,06
6.030	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	494.942	0,06
1.222	Westlake Corp	119.780	0,01
25.575	Weyerhaeuser Co (REIT)	847.044	0,10
4.713	Workday Inc - Class A	657.841	0,08

## L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 95,99 %) (Fortsetzung)</b>			
6.285	WP Carey Inc (REIT)	520.775	0,06
1.503	WW Grainger Inc	683.008	0,08
6.017	Xylem Inc/NY	470.409	0,05
10.207	Yum China Holdings Inc	495.039	0,06
7.000	Yum! Brands Inc	794.570	0,09
1.839	Zebra Technologies Corp	540.574	0,06
7.135	Zimmer Biomet Holdings Inc	749.603	0,09
15.583	Zoetis Inc	2.678.562	0,31
5.173	Zoom Video Communications Inc - Class A	558.529	0,06
7.332	ZoomInfo Technologies Inc - Class A	243.716	0,03
1.770	Zscaler Inc	264.633	0,03
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>830.156.901</b>	<b>96,55</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>858.878.729</b>	<b>99,89</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		858.878.729	99,89
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		934.547	0,11
		<b>859.813.276</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,88
Sonstige Vermögenswerte			0,12
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

## L&G Clean Energy UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien 30. Juni 2021: 99,86 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 3,61 %)</b>			
829.047	Downer EDI Ltd	2.879.036	1,58
348.890	Worley Ltd	3.416.451	1,87
<b>Australien insgesamt</b>		<b>6.295.487</b>	<b>3,45</b>
<b>Österreich (30. Juni 2021: 2,05 %)</b>			
79.423	ANDRITZ AG	3.191.788	1,75
<b>Österreich insgesamt</b>		<b>3.191.788</b>	<b>1,75</b>
<b>Britische Jungferninseln (30. Juni 2021: – %)</b>			
569.742	ReneSola Ltd ADR	2.706.274	1,48
<b>Britische Jungferninseln insgesamt</b>		<b>2.706.274</b>	<b>1,48</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 7,31 %)</b>			
105.275	Boralex Inc	3.499.464	1,92
99.460	Canadian Solar Inc	3.097.184	1,70
68.851	Enbridge Inc	2.901.424	1,59
95.673	Northland Power Inc	2.842.081	1,56
23.869	WSP Global Inc	2.693.011	1,48
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>15.033.164</b>	<b>8,25</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 3,60 %)</b>			
27.254	Orsted AS '144A'	2.842.509	1,56
108.863	Vestas Wind Systems A/S	2.294.078	1,26
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>5.136.587</b>	<b>2,82</b>
<b>Finnland (30. Juni 2021: 4,03 %)</b>			
100.756	Valmet Oyj	2.465.907	1,35
<b>Finnland insgesamt</b>		<b>2.465.907</b>	<b>1,35</b>

## L&amp;G Clean Energy UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien 30. Juni 2021: 99,86 % (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 5,29 %)</b>			
266.727	Engie SA	3.057.874	1,68
89.478	Neoen SA '144A'	3.363.878	1,84
22.082	Schneider Electric SE	2.606.374	1,43
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>9.028.126</b>	<b>4,95</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 8,92 %)</b>			
269.896	E.ON SE	2.259.565	1,24
196.202	Encavis AG	3.584.470	1,96
28.279	Energiekontor AG	2.276.455	1,25
187.341	Nordex SE	1.593.486	0,87
94.852	SMA Solar Technology AG	3.841.585	2,11
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>13.555.561</b>	<b>7,43</b>
<b>Italien (30. Juni 2021: 1,45 %)</b>			
106.970	ERG SpA	3.314.702	1,82
63.263	Saipem SpA	168.984	0,09
	<b>Italien insgesamt</b>	<b>3.483.686</b>	<b>1,91</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 14,35 %)</b>			
497.763	Hitachi Zosen Corp	3.128.995	1,72
88.915	Mitsubishi Corp	2.642.154	1,45
261.875	Mitsubishi Electric Corp	2.796.957	1,53
251.972	Sumitomo Electric Industries Ltd	2.780.215	1,53
132.548	Sumitomo Heavy Industries Ltd	2.922.096	1,60
75.595	Toyota Tsusho Corp	2.465.024	1,35
83.104	West Holdings Corp	2.232.745	1,22
188.594	Yokogawa Electric Corp	3.110.958	1,71
	<b>Japan insgesamt</b>	<b>22.079.144</b>	<b>12,11</b>

## L&amp;G Clean Energy UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien 30. Juni 2021: 99,86 % (Fortsetzung)</b>			
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: – %)</b>			
394.093	Subsea 7 SA	3.140.873	1,72
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>3.140.873</b>	<b>1,72</b>
<b>Mauritius (30. Juni 2021: 1,68 %)</b>			
189.732	Azure Power Global Ltd	2.162.945	1,19
<b>Mauritius insgesamt</b>		<b>2.162.945</b>	<b>1,19</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 3,54 %)</b>			
36.259	Alfen Beheer BV '144A'	3.341.887	1,83
340.861	Fugro NV	4.290.502	2,36
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>7.632.389</b>	<b>4,19</b>
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 1,56 %)</b>			
976.663	Aker Solutions ASA	2.645.374	1,45
243.679	Scatec ASA '144A'	2.088.107	1,15
<b>Norwegen insgesamt</b>		<b>4.733.481</b>	<b>2,60</b>
<b>Südkorea (30. Juni 2021: 4,52 %)</b>			
58.209	CS Wind Corp	2.591.251	1,42
83.596	Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	2.662.272	1,46
7.188	Samsung SDI Co Ltd	2.945.176	1,62
<b>Südkorea insgesamt</b>		<b>8.198.699</b>	<b>4,50</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: 4,22 %)</b>			
20.548	Acciona SA	3.770.084	2,07
138.955	EDP Renovaveis SA	3.271.500	1,80
70.989	Grenergy Renovables SA	2.514.426	1,38
319.477	Iberdrola SA	3.305.245	1,81

## L&amp;G Clean Energy UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien 30. Juni 2021: 99,86 % (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien (30. Juni 2021: 4,22 %) (Fortsetzung)</b>			
168.532	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	3.155.602	1,73
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>16.016.857</b>	<b>8,79</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 3,63 %)</b>			
270.546	Atlas Copco AB	2.523.185	1,39
366.216	Peab AB	2.137.101	1,17
<b>Schweden insgesamt</b>		<b>4.660.286</b>	<b>2,56</b>
<b>Taiwan (30. Juni 2021: 5,46 %)</b>			
2.288.985	China Steel Corp	2.190.177	1,20
2.117.606	CTCI Corp	3.197.757	1,76
345.341	Delta Electronics Inc	2.572.621	1,41
<b>Taiwan insgesamt</b>		<b>7.960.555</b>	<b>4,37</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 1,66 %)</b>			
3.248.209	Centrica Plc	3.155.830	1,73
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>3.155.830</b>	<b>1,73</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 22,98 %)</b>			
48.255	Ameresco Inc - Class A	2.198.498	1,21
384.764	American Superconductor Corp	1.993.077	1,09
333.019	Array Technologies Inc	3.666.539	2,01
450.962	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	2.719.301	1,49
19.402	Enphase Energy Inc	3.788.046	2,08
42.778	First Solar Inc	2.914.465	1,60
291.084	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	2.337.405	1,28
38.236	NextEra Energy Inc	2.961.761	1,63
43.074	Ormat Technologies Inc	3.374.848	1,85
10.481	SolarEdge Technologies Inc	2.868.440	1,57

## L&amp;G Clean Energy UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien 30. Juni 2021: 99,86 % (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 22,98 %) (Fortsetzung)</b>			
3.636	Tesla Inc	2.448.555	1,34
254.458	TPI Composites Inc	3.180.725	1,75
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>34.451.660</b>	<b>18,90</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>175.089.299</b>	<b>96,05</b>
<b>Bezugsrecht (30. Juni 2021: in %)</b>			
<b>Italien (30. Juni 2021: – %)</b>			
63.263	Saipem S.p.A. (Rights) 19/07/2022	83.334	0,05
<b>Italien insgesamt</b>		<b>83.334</b>	<b>0,05</b>
<b>Bezugsrechte insgesamt</b>		<b>83.334</b>	<b>0,05</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		175.089.299	96,05
Bezugsrechte		83.334	0,05
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen		7.124.765	3,90
		<b>182.297.398</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			96,05
Sonstige Vermögenswerte			3,95
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,84 %)</b>					
<b>Australien (30. Juni 2021: 2,70 %)</b>					
400.000	APA Infrastructure Ltd 'EMTN'	4,25 %	26.11.2024	405.025	0,59
300.000	Macquarie Bank Ltd 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	275.022	0,40
300.000	Westfield America Management Ltd	2,13 %	30.03.2025	273.622	0,40
<b>Australien insgesamt</b>				<b>953.669</b>	<b>1,39</b>
<b>Belgien (30. Juni 2021: 1,57 %)</b>					
400.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	9,75 %	30.07.2024	451.702	0,65
350.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	4,00 %	24.09.2025	356.889	0,52
<b>Belgien insgesamt</b>				<b>808.591</b>	<b>1,17</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 2,36 %)</b>					
430.000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,50 %	18.12.2024	407.088	0,59
650.000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	579.193	0,84
250.000	Bank of Nova Scotia/The 'EMTN'	1,25 %	17.12.2025	228.658	0,33
200.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	1,38 %	09.12.2024	189.734	0,28
400.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	365.988	0,53
430.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	384.110	0,56
670.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN'	2,88 %	05.04.2027	638.835	0,93
<b>Kanada insgesamt</b>				<b>2.793.606</b>	<b>4,06</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,72 %)</b>					
350.000	Southern Water Services Finance Ltd	6,64 %	31.03.2026	389.910	0,57
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>				<b>389.910</b>	<b>0,57</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: – %)</b>					
400.000	Orsted AS 'EMTN'	2,13 %	17.05.2027	379.644	0,55
<b>Dänemark insgesamt</b>				<b>379.644</b>	<b>0,55</b>

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,84 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Finnland (30. Juni 2021: – %)</b>					
400.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN'	3,38 %	14.01.2026	394.932	0,57
500.000	OP Corporate Bank plc 'GMTN'	1,38 %	04.09.2026	451.067	0,66
<b>Finnland insgesamt</b>				<b>845.999</b>	<b>1,23</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 8,77 %)</b>					
600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA	1,25 %	05.12.2025	553.397	0,80
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,88 %	13.12.2022	398.967	0,58
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	2,25 %	18.12.2023	392.530	0,57
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,75 %	19.12.2024	477.126	0,69
600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,00 %	16.07.2026	541.083	0,79
700.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	3,38 %	23.01.2026	679.442	0,99
400.000	BPCE SA	2,13 %	16.12.2022	399.466	0,58
400.000	BPCE SA 'EMTN'	1,00 %	22.12.2025	363.099	0,53
200.000	BPCE SA 'EMTN'	1,38 %	23.12.2026	179.830	0,26
100.000	Credit Agricole SA 'GMTN'	7,38 %	18.12.2023	103.904	0,15
800.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,00 %	11.02.2023	792.922	1,15
900.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,13 %	11.02.2027	829.443	1,20
300.000	Vinci SA 'EMTN'	2,25 %	15.03.2027	287.270	0,42
<b>Frankreich insgesamt</b>				<b>5.998.479</b>	<b>8,71</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 3,17 %)</b>					
400.000	Deutsche Bank AG 'EMTN'	3,88 %	12.02.2024	394.904	0,58
500.000	Deutsche Bank AG 'EMTN'	2,63 %	16.12.2024	476.354	0,69
<b>Deutschland insgesamt</b>				<b>871.258</b>	<b>1,27</b>
<b>Jersey (30. Juni 2021: 4,75 %)</b>					
530.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN'	4,88 %	31.07.2024	527.095	0,76
480.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN'	6,27 %	31.07.2025	494.864	0,72
200.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	5,25 %	23.01.2024	205.084	0,30

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,84 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Jersey (30. Juni 2021: 4,75 %) (Fortsetzung)</b>					
600.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	6,13 %	02.03.2026	646.429	0,94
630.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	7,13 %	14.02.2024	656.331	0,95
400.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	6,75 %	03.12.2026	444.824	0,64
590.000	Heathrow Funding Ltd 'REGS'	5,23 %	15.02.2023	596.752	0,87
<b>Jersey insgesamt</b>				<b>3.571.379</b>	<b>5,18</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: – %)</b>					
300.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN'	2,00 %	20.10.2025	271.204	0,39
200.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN'	2,25 %	30.11.2023	199.023	0,29
<b>Luxemburg insgesamt</b>				<b>470.227</b>	<b>0,68</b>
<b>Mexiko (30. Juni 2021: – %)</b>					
200.000	America Movil SAB de CV	5,00 %	27.10.2026	213.052	0,31
<b>Mexiko insgesamt</b>				<b>213.052</b>	<b>0,31</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 12,49 %)</b>					
300.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN'	1,25 %	14.01.2025	281.587	0,41
320.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN'	1,25 %	06.10.2023	312.909	0,46
320.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN'	2,50 %	10.10.2025	312.712	0,45
800.000	ING Groep NV 'EMTN'	3,00 %	18.02.2026	767.168	1,11
200.000	Koninklijke KPN NV 'GMTN'	5,00 %	18.11.2026	207.508	0,30
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	0,88 %	05.06.2023	295.257	0,43
500.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	1,00 %	20.02.2025	474.707	0,69
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	2,75 %	10.09.2025	297.514	0,43
100.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV 'EMTN'	0,75 %	19.12.2025	91.785	0,13
<b>Niederlande insgesamt</b>				<b>3.041.147</b>	<b>4,41</b>
<b>Norwegen (30. Juni 2021: – %)</b>					
260.000	DNB Bank ASA 'EMTN'	1,63 %	15.12.2023	253.552	0,37

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,84 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Norwegen (30. Juni 2021: – %) (Fortsetzung)</b>					
1.096.000	DNB Bank ASA FRN		10.06.2026	1.064.453	1,54
<b>Norwegen insgesamt</b>				<b>1.318.005</b>	<b>1,91</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: 4,65 %)</b>					
600.000	Banco Santander SA 'EMTN'	2,75 %	12.09.2023	591.637	0,86
900.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,38 %	31.07.2024	860.440	1,25
700.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,50 %	14.04.2026	630.551	0,91
600.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,75 %	17.02.2027	532.308	0,77
400.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN		06.10.2026	383.889	0,56
600.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN		03.12.2026	541.022	0,79
100.000	Telefonica Emisiones SA 'EMTN'	5,29 %	09.12.2022	101.137	0,15
600.000	Telefonica Emisiones SA 'EMTN'	5,38 %	02.02.2026	635.260	0,92
<b>Spanien insgesamt</b>				<b>4.276.244</b>	<b>6,21</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 1,66 %)</b>					
517.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	464.904	0,67
260.000	Credit Suisse Group AG	2,75 %	08.08.2025	245.786	0,36
540.000	Credit Suisse Group AG FRN		12.09.2025	510.250	0,74
300.000	UBS AG/London 'EMTN'	0,63 %	18.12.2023	288.054	0,42
<b>Schweiz insgesamt</b>				<b>1.508.994</b>	<b>2,19</b>
<b>Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2021: 0,99 %)</b>					
600.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 'EMTN'	0,88 %	09.12.2025	546.750	0,79
<b>Vereinigte Arabische Emirate insgesamt</b>				<b>546.750</b>	<b>0,79</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 35,62 %)</b>					
500.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	2,65 %	12.07.2025	477.820	0,69
460.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,13 %	17.01.2024	453.774	0,66
500.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,00 %	08.05.2026	472.463	0,69
850.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,25 %	12.02.2027	798.040	1,16

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,84 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 35,62 %) (Fortsetzung)</b>					
1.030.000	Barclays Plc FRN		06.10.2023	1.027.561	1,49
300.000	Barclays Plc FRN		03.11.2026	273.285	0,40
400.000	BUPA Finance Plc	2,00 %	05.04.2024	390.464	0,57
300.000	BUPA Finance Plc	5,00 %	08.12.2026	298.090	0,43
300.000	BUPA Finance Plc	1,75 %	14.06.2027	271.734	0,39
220.000	Coventry Building Society 'EMTN'	5,88 %	28.09.2022	221.780	0,32
570.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,50 %	23.01.2023	565.384	0,82
360.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,88 %	24.10.2023	352.373	0,51
420.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,00 %	21.09.2025	386.011	0,56
430.000	Diageo Finance Plc 'EMTN'	1,75 %	12.10.2026	407.947	0,59
310.000	Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	5,75 %	08.03.2024	322.660	0,47
350.000	Electricity North West Ltd	8,88 %	25.03.2026	417.952	0,61
330.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	2,13 %	27.09.2024	322.038	0,47
530.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	0,74 %	29.10.2025	488.444	0,71
240.000	HSBC Bank Plc 'EMTN'	6,50 %	07.07.2023	244.862	0,36
517.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	6,50 %	20.05.2024	540.947	0,79
700.000	HSBC Holdings Plc FRN		13.11.2026	651.344	0,95
200.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN'	3,75 %	14.08.2025	197.357	0,29
409.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN'	2,13 %	24.08.2026	371.550	0,54
450.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	1,97 %	08.02.2024	442.266	0,64
500.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,38 %	29.03.2027	483.291	0,70
280.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN'	1,50 %	23.06.2023	275.433	0,40
530.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN'	1,75 %	11.07.2024	510.630	0,74
510.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN'	7,50 %	15.04.2024	545.465	0,79
700.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN'	7,63 %	22.04.2025	753.249	1,09
650.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN'	2,25 %	16.10.2024	624.854	0,91
276.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' FRN		12.04.2028	247.699	0,36
600.000	Lloyds Banking Group Plc FRN		15.01.2026	565.112	0,82
200.000	London & Quadrant Housing Trust	2,63 %	05.05.2026	196.506	0,29
300.000	Manchester Airport Group Funding Plc 'EMTN'	4,13 %	02.04.2024	304.358	0,44
400.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN'	1,38 %	16.09.2026	369.978	0,54

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,84 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 35,62 %) (Fortsetzung)</b>					
300.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN'	4,00 %	08.06.2027	305.154	0,44
300.000	National Grid Plc	3,50 %	16.10.2026	299.223	0,43
480.000	Nationwide Building Society	1,00 %	24.01.2023	475.276	0,69
550.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN		19.09.2026	522.868	0,76
300.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN		28.03.2027	283.894	0,41
270.000	Northumbrian Water Finance Plc	6,88 %	06.02.2023	276.193	0,40
220.000	Northumbrian Water Finance Plc	1,63 %	11.10.2026	206.081	0,30
425.000	Pension Insurance Corp Plc	6,50 %	03.07.2024	438.609	0,64
410.000	Phoenix Group Holdings Plc	6,63 %	18.12.2025	424.597	0,62
813.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN'	4,87 %	06.05.2026	801.403	1,16
564.000	Rothsay Life Plc	3,38 %	12.07.2026	525.308	0,76
600.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN'	3,63 %	14.01.2026	585.779	0,85
500.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN' FRN		08.05.2026	478.510	0,69
720.000	Scottish Widows Ltd	5,50 %	16.06.2023	726.881	1,05
300.000	Severn Trent Utilities Finance Plc	6,13 %	26.02.2024	313.902	0,46
480.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	3,63 %	16.01.2026	486.672	0,71
150.000	Sky Ltd 'EMTN'	6,00 %	21.05.2027	167.965	0,24
200.000	Southern Gas Networks Plc 'EMTN'	4,88 %	05.10.2023	203.966	0,30
300.000	Southern Gas Networks Plc 'EMTN'	2,50 %	03.02.2025	294.890	0,43
210.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN'	2,50 %	02.05.2025	199.815	0,29
557.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,00 %	19.06.2025	567.640	0,82
570.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	2,00 %	14.02.2025	556.901	0,81
500.000	Virgin Money UK Plc 'EMTN' FRN		25.09.2026	483.726	0,70
100.000	Virgin Money UK Plc 'EMTN' FRN		19.08.2031	86.758	0,13
400.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN		22.06.2025	388.729	0,56
300.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN		24.04.2026	285.688	0,41
400.000	Western Power Distribution Plc	3,63 %	06.11.2023	401.525	0,58
300.000	Western Power Distribution West Midlands Plc 'EMTN'	3,88 %	17.10.2024	303.123	0,44
380.000	Whitbread Group Plc	3,38 %	16.10.2025	367.189	0,53
300.000	Whitbread Group Plc	2,38 %	31.05.2027	268.428	0,39

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,84 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 35,62 %) (Fortsetzung)</b>					
300.000	Yorkshire Building Society 'EMTN'	3,50 %	21.04.2026	298.215	0,43
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>				<b>27.297.629</b>	<b>39,62</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 16,05 %)</b>					
250.000	American Honda Finance Corp	0,75 %	25.11.2026	222.461	0,32
410.000	Amgen Inc	5,50 %	07.12.2026	446.244	0,65
700.000	AT&T Inc	2,90 %	04.12.2026	679.601	0,99
250.000	AT&T Inc	5,50 %	15.03.2027	269.054	0,39
490.000	Bank of America Corp 'EMTN'	2,30 %	25.07.2025	470.727	0,68
390.000	Citigroup Inc	2,75 %	24.01.2024	384.827	0,56
550.000	Citigroup Inc	1,75 %	23.10.2026	499.390	0,72
284.000	Citigroup Inc 'EMTN'	5,15 %	21.05.2026	295.341	0,43
500.000	Digital Stout Holding LLC 'EMTN'	4,25 %	17.01.2025	501.675	0,73
536.000	Fiserv Inc	2,25 %	01.07.2025	513.953	0,74
100.000	General Motors Financial Co Inc 'EMTN'	2,25 %	06.09.2024	95.982	0,14
100.000	General Motors Financial Co Inc 'EMTN'	2,35 %	03.09.2025	94.049	0,14
180.000	Goldman Sachs Group Inc/The	7,13 %	07.08.2025	195.983	0,28
600.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	4,25 %	29.01.2026	601.497	0,87
400.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN		16.12.2025	369.604	0,54
430.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN'	3,50 %	18.12.2026	425.403	0,62
1.060.000	JPMorgan Chase & Co FRN		28.04.2026	974.248	1,41
370.000	MetLife Inc	5,38 %	09.12.2024	384.477	0,56
370.000	Metropolitan Life Global Funding I 'EMTN'	2,88 %	11.01.2023	369.908	0,54
430.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	2,63 %	05.12.2022	429.979	0,62
483.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	3,50 %	30.09.2026	482.099	0,70
310.000	Morgan Stanley 'GMTN'	2,63 %	09.03.2027	293.883	0,43
477.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	0,63 %	18.12.2025	444.230	0,64
255.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	2,13 %	04.04.2027	245.086	0,35
770.000	New York Life Global Funding	1,63 %	15.12.2023	752.572	1,09
200.000	New York Life Global Funding 'GMTN'	1,75 %	15.12.2022	199.332	0,29

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,84 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 16,05 %) (Fortsetzung)</b>					
430.000	New York Life Global Funding 'GMTN'	1,25 %	17.12.2026	390.443	0,57
300.000	Toyota Motor Credit Corp	0,75 %	19.11.2026	268.034	0,39
420.000	Verizon Communications Inc	4,07 %	18.06.2024	426.266	0,62
260.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,13 %	20.12.2023	253.779	0,37
630.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,00 %	28.07.2025	596.731	0,87
411.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' FRN		26.04.2028	397.679	0,58
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>				<b>12.974.537</b>	<b>18,83</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>68.259.120</b>	<b>99,08</b>
<b>Gesamtanlagen</b>					
Unternehmensanleihen				68.259.120	99,08
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten*				637.173	0,92
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>68.896.293</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					<b>% des Gesamtvermögens</b>
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					97,26
Sonstige Vermögenswerte					2,74
					<b>100,00</b>
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 6.860 £ enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %)</b>					
<b>Australien (30. Juni 2021: 1,66 %)</b>					
420.000	APA Infrastructure Ltd	3,13 %	18.07.2031	372.787	0,44
100.000	APA Infrastructure Ltd 'EMTN'	4,25 %	26.11.2024	101.257	0,12
150.000	APA Infrastructure Ltd 'EMTN'	3,50 %	22.03.2030	139.997	0,17
203.000	Macquarie Bank Ltd 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	186.098	0,22
100.000	Macquarie Group Ltd 'EMTN'	2,13 %	01.10.2031	80.610	0,09
100.000	Westfield America Management Ltd	2,13 %	30.03.2025	91.207	0,11
300.000	Westfield America Management Ltd	2,63 %	30.03.2029	248.981	0,29
<b>Australien insgesamt</b>				<b>1.220.937</b>	<b>1,44</b>
<b>Belgien (30. Juni 2021: 0,99 %)</b>					
100.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	9,75 %	30.07.2024	112.926	0,13
200.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	4,00 %	24.09.2025	203.936	0,24
300.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	2,25 %	24.05.2029	271.376	0,32
200.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	2,85 %	25.05.2037	165.508	0,20
<b>Belgien insgesamt</b>				<b>753.746</b>	<b>0,89</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 0,45 %)</b>					
100.000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,50 %	18.12.2024	94.672	0,11
400.000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	356.426	0,42
100.000	Bank of Nova Scotia/The 'EMTN'	1,25 %	17.12.2025	91.463	0,11
200.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	182.994	0,22
350.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN'	2,88 %	05.04.2027	333.720	0,39
<b>Kanada insgesamt</b>				<b>1.059.275</b>	<b>1,25</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,76 %)</b>					
140.000	Southern Water Services Finance Ltd	6,64 %	31.03.2026	155.964	0,18
300.000	Southern Water Services Finance Ltd 'EMTN'	2,38 %	28.05.2028	279.639	0,33
220.000	Southern Water Services Finance Ltd 'EMTN'	3,00 %	28.05.2037	186.412	0,22
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>				<b>622.015</b>	<b>0,73</b>

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 0,51 %)</b>					
300.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN		14.01.2028	270.991	0,32
200.000	Orsted AS 'EMTN'	2,13 %	17.05.2027	189.822	0,22
200.000	Orsted AS 'EMTN'	2,50 %	16.05.2033	175.969	0,21
130.000	Orsted AS FRN		18.02.3021	88.835	0,11
<b>Dänemark insgesamt</b>				<b>725.617</b>	<b>0,86</b>
<b>Finnland (30. Juni 2021: – %)</b>					
100.000	Nordea Bank Abp 'EMTN' FRN		09.12.2032	83.372	0,10
100.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN'	3,38 %	14.01.2026	98.733	0,12
100.000	OP Corporate Bank plc 'GMTN'	1,38 %	04.09.2026	90.213	0,10
<b>Finnland insgesamt</b>				<b>272.318</b>	<b>0,32</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 6,39 %)</b>					
300.000	AXA SA 'EMTN' FRN		16.01.2054	285.078	0,34
350.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Perpetual)		04.03.2026	348.714	0,41
100.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Perpetual)		06.07.2026	103.953	0,12
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA	1,25 %	05.12.2025	276.698	0,33
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	2,25 %	18.12.2023	98.133	0,12
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,75 %	19.12.2024	286.275	0,34
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,00 %	16.07.2026	360.722	0,43
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	0,88 %	07.12.2027	258.040	0,30
200.000	BNP Paribas SA	1,88 %	14.12.2027	177.101	0,21
300.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	3,38 %	23.01.2026	291.189	0,34
200.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	2,88 %	24.02.2029	182.960	0,22
200.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	1,25 %	13.07.2031	153.029	0,18
300.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	2,00 %	13.09.2036	214.357	0,25
400.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN		24.05.2031	348.513	0,41
100.000	BPCE SA	2,13 %	16.12.2022	99.867	0,12

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 6,39 %) (Fortsetzung)</b>					
300.000	BPCE SA	5,25 %	16.04.2029	298.773	0,35
100.000	BPCE SA 'EMTN'	1,00 %	22.12.2025	90.775	0,11
100.000	BPCE SA 'EMTN'	1,38 %	23.12.2026	89.915	0,11
200.000	BPCE SA FRN		30.11.2032	170.809	0,20
100.000	Credit Agricole SA FRN		09.12.2031	85.632	0,10
100.000	Credit Agricole SA 'GMTN'	7,38 %	18.12.2023	103.904	0,12
100.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,00 %	11.02.2023	99.115	0,12
400.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,13 %	11.02.2027	368.641	0,44
205.000	Orange SA 'EMTN'	8,13 %	20.11.2028	257.514	0,30
200.000	Orange SA 'EMTN'	3,25 %	15.01.2032	189.871	0,22
100.000	Orange SA 'EMTN'	5,63 %	23.01.2034	113.933	0,13
150.000	Orange SA 'EMTN'	5,38 %	22.11.2050	175.259	0,21
100.000	Orange SA 'EMTN' FRN (Perpetual)		01.04.2023	100.008	0,12
100.000	Vinci SA 'EMTN'	2,25 %	15.03.2027	95.757	0,11
200.000	Vinci SA 'EMTN'	2,75 %	15.09.2034	177.640	0,21
	<b>Frankreich insgesamt</b>			<b>5.902.175</b>	<b>6,97</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 1,24 %)</b>					
100.000	Deutsche Bank AG 'EMTN'	3,88 %	12.02.2024	98.726	0,12
200.000	Deutsche Bank AG 'EMTN'	2,63 %	16.12.2024	190.542	0,22
300.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN		22.12.2028	251.868	0,30
100.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN'	3,13 %	06.02.2034	90.043	0,11
100.000	Henkel AG & Co KGaA	1,25 %	30.09.2026	93.113	0,11
	<b>Deutschland insgesamt</b>			<b>724.292</b>	<b>0,86</b>
<b>Jersey (30. Juni 2021: 4,29 %)</b>					
400.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN'	4,88 %	31.07.2024	397.808	0,47
200.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN'	6,27 %	31.07.2025	206.193	0,24
100.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN'	7,38 %	31.07.2029	99.993	0,12

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Jersey (30. Juni 2021: 4,29 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Gatwick Funding Ltd	2,88 %	05.07.2049	70.606	0,08
300.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	5,25 %	23.01.2024	307.627	0,36
125.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	6,13 %	02.03.2026	134.673	0,16
100.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	4,63 %	27.03.2034	98.710	0,12
125.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	5,75 %	23.01.2037	133.890	0,16
200.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	3,13 %	28.09.2039	158.831	0,19
200.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	2,63 %	07.10.2046	136.691	0,16
130.000	Gatwick Funding Ltd 'EMTN'	3,25 %	26.02.2048	99.458	0,12
300.000	Heathrow Funding Ltd	2,63 %	16.03.2028	267.195	0,32
230.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	7,13 %	14.02.2024	239.613	0,28
400.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	6,75 %	03.12.2026	444.824	0,52
200.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	2,75 %	13.10.2029	182.033	0,21
260.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	5,88 %	13.05.2041	292.913	0,35
225.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	4,63 %	31.10.2046	217.909	0,26
200.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	2,75 %	09.08.2049	139.040	0,16
100.000	Heathrow Funding Ltd 'REGS'	5,23 %	15.02.2023	101.144	0,12
340.000	Heathrow Funding Ltd 'REGS'	6,45 %	10.12.2031	394.869	0,47
<b>Jersey insgesamt</b>				<b>4.124.020</b>	<b>4,87</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 1,14 %)</b>					
300.000	Aroundtown SA 'EMTN'	3,00 %	16.10.2029	252.752	0,30
230.000	Aroundtown SA 'EMTN' FRN (Perpetual)		25.06.2024	195.740	0,23
100.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl	4,88 %	29.04.2032	93.747	0,11
200.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN'	2,00 %	20.10.2025	180.802	0,21
220.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN'	2,63 %	20.10.2028	187.680	0,22
200.000	CK Hutchison Group Telecom Finance SA	2,00 %	17.10.2027	176.434	0,21
<b>Luxemburg insgesamt</b>				<b>1.087.155</b>	<b>1,28</b>

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Mexiko (30. Juni 2021: 0,56 %)</b>					
100.000	America Movil SAB de CV	5,00 %	27.10.2026	106.526	0,13
160.000	America Movil SAB de CV	5,75 %	28.06.2030	179.196	0,21
100.000	America Movil SAB de CV	4,38 %	07.08.2041	96.461	0,11
300.000	America Movil SAB de CV 'EMTN'	4,95 %	22.07.2033	319.399	0,38
<b>Mexiko insgesamt</b>				<b>701.582</b>	<b>0,83</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 6,51 %)</b>					
200.000	Allianz Finance II BV	4,50 %	13.03.2043	215.035	0,25
100.000	Cooperatieve Rabobank UA 'EMTN'	5,25 %	14.09.2027	100.885	0,12
400.000	Cooperatieve Rabobank UA 'EMTN'	4,63 %	23.05.2029	386.655	0,46
100.000	Cooperatieve Rabobank UA 'EMTN'	5,38 %	03.08.2060	133.563	0,16
200.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN		12.07.2028	181.381	0,21
100.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN'	1,25 %	14.01.2025	93.863	0,11
90.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN'	5,25 %	23.05.2041	106.152	0,12
80.000	Deutsche Telekom International Finance BV	7,63 %	15.06.2030	100.988	0,12
180.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN'	1,25 %	06.10.2023	176.011	0,21
100.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN'	2,50 %	10.10.2025	97.723	0,12
400.000	ING Groep NV 'EMTN'	3,00 %	18.02.2026	383.584	0,45
200.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN		07.12.2028	167.601	0,20
150.000	Koninklijke KPN NV 'GMTN'	5,00 %	18.11.2026	155.631	0,18
450.000	Koninklijke KPN NV 'GMTN'	5,75 %	17.09.2029	480.738	0,57
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	1,00 %	20.02.2025	284.824	0,34
100.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	2,75 %	10.09.2025	99.171	0,12
100.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'	3,75 %	10.09.2042	100.413	0,12
<b>Niederlande insgesamt</b>				<b>3.264.218</b>	<b>3,86</b>
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 0,48 %)</b>					
100.000	DNB Bank ASA 'EMTN' FRN		02.12.2025	94.780	0,11
453.000	DNB Bank ASA FRN		10.06.2026	439.961	0,52
320.000	Equinor ASA 'EMTN'	6,88 %	11.03.2031	398.251	0,47
<b>Norwegen insgesamt</b>				<b>932.992</b>	<b>1,10</b>

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Spanien (30. Juni 2021: 1,91 %)</b>					
200.000	Banco Santander SA 'EMTN'	2,75 %	12.09.2023	197.212	0,23
200.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,38 %	31.07.2024	191.209	0,23
400.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,50 %	14.04.2026	360.315	0,43
300.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,75 %	17.02.2027	266.154	0,31
300.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN		06.10.2026	287.917	0,34
400.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN		04.10.2032	331.308	0,39
300.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN		03.12.2026	270.511	0,32
300.000	CaixaBank SA FRN		06.04.2028	282.499	0,33
50.000	Telefonica Emisiones SA 'EMTN'	5,29 %	09.12.2022	50.568	0,06
100.000	Telefonica Emisiones SA 'EMTN'	5,38 %	02.02.2026	105.877	0,13
150.000	Telefonica Emisiones SA 'EMTN'	5,45 %	08.10.2029	161.267	0,19
<b>Spanien insgesamt</b>				<b>2.504.837</b>	<b>2,96</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 0,62 %)</b>					
211.000	Credit Suisse AG/London 'EMTN'	1,13 %	15.12.2025	189.738	0,23
400.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN		09.06.2028	349.553	0,41
200.000	Credit Suisse Group AG FRN		12.09.2025	188.981	0,22
200.000	Credit Suisse Group AG FRN		15.11.2029	165.798	0,20
<b>Schweiz insgesamt</b>				<b>894.070</b>	<b>1,06</b>
<b>Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2021: 0,29 %)</b>					
300.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 'EMTN'	0,88 %	09.12.2025	273.375	0,32
<b>Vereinigte Arabische Emirate insgesamt</b>				<b>273.375</b>	<b>0,32</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 52,56 %)</b>					
310.000	3i Group Plc	3,75 %	05.06.2040	263.030	0,31
100.000	3i Group Plc 'EMTN'	5,75 %	03.12.2032	109.527	0,13
100.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	2,65 %	12.07.2025	95.564	0,11
300.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	3,18 %	12.07.2029	275.110	0,32
100.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	2,31 %	06.10.2032	80.621	0,10

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 52,56 %) (Fortsetzung)</b>					
120.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	3,69 %	12.07.2034	106.121	0,13
200.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	3,94 %	12.07.2047	164.845	0,19
100.000	Annington Funding Plc 'EMTN'	2,92 %	06.10.2051	67.266	0,08
157.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN		12.09.2049	146.291	0,17
100.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN		04.06.2050	95.024	0,11
250.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN		20.05.2058	273.661	0,32
250.000	Aviva Plc FRN		14.11.2036	256.651	0,30
200.000	Aviva Plc FRN		03.06.2055	161.766	0,19
200.000	Aviva Plc FRN (Perpetual)		29.09.2022	200.379	0,24
300.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,13 %	17.01.2024	295.939	0,35
200.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,00 %	08.05.2026	188.985	0,22
500.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,25 %	12.02.2027	469.435	0,55
300.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,25 %	17.01.2033	256.152	0,30
240.000	Barclays Plc FRN		06.10.2023	239.432	0,28
100.000	Barclays Plc FRN		03.11.2026	91.095	0,11
300.000	Barclays Plc FRN		22.11.2030	282.324	0,33
230.000	British Telecommunications Plc	5,75 %	07.12.2028	248.617	0,29
350.000	British Telecommunications Plc 'EMTN'	3,13 %	21.11.2031	315.752	0,37
150.000	British Telecommunications Plc 'EMTN'	6,38 %	23.06.2037	165.922	0,20
100.000	BUPA Finance Plc	2,00 %	05.04.2024	97.616	0,12
200.000	BUPA Finance Plc	1,75 %	14.06.2027	181.156	0,21
100.000	BUPA Finance Plc	4,13 %	14.06.2035	83.499	0,10
500.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	2,13 %	22.09.2028	455.042	0,54
200.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	2,25 %	10.10.2035	153.911	0,18
150.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	2,63 %	22.09.2038	116.082	0,14
150.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	3,13 %	21.03.2040	121.848	0,14
410.000	Cadent Finance Plc 'EMTN'	2,75 %	22.09.2046	293.637	0,35
150.000	Centrica Plc 'EMTN'	4,38 %	13.03.2029	153.031	0,18
441.000	Centrica Plc 'EMTN'	7,00 %	19.09.2033	526.323	0,62
200.000	Centrica Plc 'EMTN'	4,25 %	12.09.2044	178.089	0,21

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 52,56 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Clarion Funding Plc 'EMTN'	2,63 %	18.01.2029	95.780	0,11
120.000	Clarion Funding Plc 'EMTN'	1,25 %	13.11.2032	95.620	0,11
130.000	Clarion Funding Plc 'EMTN'	1,88 %	22.01.2035	103.614	0,12
436.000	Clarion Funding Plc 'EMTN'	3,13 %	19.04.2048	369.620	0,44
397.870	Connect Plus M25 Issuer Plc	2,61 %	31.03.2039	371.048	0,44
100.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,50 %	23.01.2023	99.190	0,12
200.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,88 %	24.10.2023	195.763	0,23
270.000	Coventry Building Society 'EMTN'	1,00 %	21.09.2025	248.150	0,29
200.000	Diageo Finance Plc	2,88 %	27.03.2029	193.377	0,23
135.000	Diageo Finance Plc	2,75 %	08.06.2038	115.944	0,14
200.000	Diageo Finance Plc 'EMTN'	1,75 %	12.10.2026	189.743	0,22
220.000	Diageo Finance Plc 'EMTN'	2,38 %	08.06.2028	208.791	0,25
200.000	Diageo Finance Plc 'EMTN'	1,25 %	28.03.2033	156.436	0,18
150.000	Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	5,75 %	08.03.2024	156.126	0,18
200.000	Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	1,88 %	01.06.2035	154.457	0,18
100.000	Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	6,25 %	12.11.2036	121.637	0,14
200.000	Electricity North West Ltd	8,88 %	25.03.2026	238.830	0,28
100.000	ENW Finance Plc	1,42 %	30.07.2030	84.047	0,10
92.857	Eversholt Funding Plc 'EMTN'	6,70 %	22.02.2035	106.428	0,13
199.231	Eversholt Funding Plc 'EMTN'	2,74 %	30.06.2040	178.664	0,21
100.000	Eversholt Funding Plc 'EMTN'	3,53 %	07.08.2042	87.698	0,10
210.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	2,13 %	27.09.2024	204.933	0,24
200.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	0,74 %	29.10.2025	184.318	0,22
210.000	Experian Finance Plc 'EMTN'	3,25 %	07.04.2032	199.800	0,24
300.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	3,38 %	20.12.2027	302.866	0,36
220.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	1,25 %	12.10.2028	196.380	0,23
235.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	5,25 %	19.12.2033	273.242	0,32
200.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	1,63 %	12.05.2035	157.816	0,19
150.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	6,38 %	09.03.2039	195.834	0,23
500.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	5,25 %	10.04.2042	592.801	0,70

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 52,56 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	4,25 %	18.12.2045	105.247	0,12
120.000	HSBC Bank Plc 'EMTN'	6,50 %	07.07.2023	122.431	0,14
230.000	HSBC Bank Plc 'EMTN'	5,38 %	22.08.2033	228.673	0,27
360.000	HSBC Bank Plc 'EMTN'	4,75 %	24.03.2046	316.324	0,37
300.000	HSBC Holdings Plc	2,63 %	16.08.2028	272.701	0,32
300.000	HSBC Holdings Plc	6,75 %	11.09.2028	316.994	0,37
200.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	6,50 %	20.05.2024	209.264	0,25
200.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	5,75 %	20.12.2027	200.688	0,24
150.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	7,00 %	07.04.2038	158.753	0,19
200.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN'	6,00 %	29.03.2040	190.474	0,23
300.000	HSBC Holdings Plc FRN		13.11.2026	279.147	0,33
310.000	HSBC Holdings Plc FRN		24.07.2027	278.500	0,33
328.000	HSBC Holdings Plc FRN		22.07.2028	305.457	0,36
200.000	HSBC Holdings Plc FRN		29.05.2030	179.317	0,21
100.000	Hyde Housing Association Ltd	1,75 %	18.08.2055	59.251	0,07
300.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN'	2,13 %	24.08.2026	272.531	0,32
200.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN'	3,38 %	08.10.2028	182.634	0,22
200.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	1,97 %	08.02.2024	196.563	0,23
130.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,38 %	29.03.2027	125.656	0,15
100.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,40 %	08.02.2029	95.263	0,11
110.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,63 %	22.09.2037	95.886	0,11
300.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,75 %	22.09.2057	241.534	0,29
204.000	Legal & General Finance Plc 'EMTN'	5,88 %	11.12.2031	235.912	0,28
100.000	Legal & General Group Plc 'EMTN' FRN		27.06.2064	90.127	0,11
380.000	Legal & General Group Plc FRN		14.11.2048	367.840	0,43
400.000	Legal & General Group Plc FRN		01.11.2050	360.312	0,43
200.000	Legal & General Group Plc FRN (Perpetual)		24.03.2031	169.591	0,20
100.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN'	1,50 %	23.06.2023	98.369	0,12
100.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN'	1,75 %	11.07.2024	96.345	0,11
200.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN'	7,50 %	15.04.2024	213.908	0,25

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 52,56 %) (Fortsetzung)</b>					
140.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN'	7,63 %	22.04.2025	150.650	0,18
180.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN'	6,50 %	17.09.2040	233.218	0,28
200.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN'	2,25 %	16.10.2024	192.263	0,23
600.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' FRN		12.04.2028	538.475	0,64
500.000	Lloyds Banking Group Plc FRN		15.01.2026	470.927	0,56
140.000	Lloyds Banking Group Plc FRN		15.12.2031	120.230	0,14
350.000	Lloyds Banking Group Plc FRN		03.12.2035	274.730	0,32
100.000	London & Quadrant Housing Trust	2,63 %	05.05.2026	98.253	0,12
110.000	London & Quadrant Housing Trust	5,50 %	27.01.2040	128.606	0,15
200.000	London & Quadrant Housing Trust 'EMTN'	2,00 %	31.03.2032	173.500	0,20
100.000	London Power Networks Plc 'EMTN'	6,13 %	07.06.2027	112.361	0,13
200.000	M&G Plc 'EMTN' FRN		20.07.2055	180.228	0,21
150.000	M&G Plc 'EMTN' FRN		19.12.2063	137.106	0,16
100.000	M&G Plc FRN		20.07.2049	98.135	0,12
260.000	M&G Plc FRN		20.10.2051	247.561	0,29
400.000	M&G Plc FRN		20.10.2068	356.855	0,42
100.000	Manchester Airport Group Funding Plc 'EMTN'	4,13 %	02.04.2024	101.453	0,12
200.000	Manchester Airport Group Funding Plc 'EMTN'	4,75 %	31.03.2034	205.666	0,24
100.000	Manchester Airport Group Funding Plc 'EMTN'	2,88 %	30.09.2044	75.066	0,09
100.000	Martlet Homes Ltd	3,00 %	09.05.2052	82.876	0,10
200.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN'	4,00 %	08.06.2027	203.436	0,24
320.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN'	1,13 %	07.07.2028	277.210	0,33
300.000	National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN'	2,00 %	17.04.2040	211.505	0,25
200.000	National Grid Plc	3,50 %	16.10.2026	199.482	0,24
100.000	Nationwide Building Society	1,00 %	24.01.2023	99.016	0,12
310.000	Nationwide Building Society 'EMTN'	3,25 %	20.01.2028	303.132	0,36
100.000	Nats En Route Plc	1,38 %	31.03.2031	90.914	0,11
250.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN		19.09.2026	237.667	0,28
150.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN		28.03.2027	141.947	0,17
300.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN		28.11.2031	257.318	0,30

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 52,56 %) (Fortsetzung)</b>					
232.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN		29.03.2029	217.738	0,26
300.000	NatWest Group Plc FRN		14.08.2030	281.777	0,33
200.000	NatWest Group Plc FRN		09.11.2028	175.161	0,21
50.000	Northumbrian Water Finance Plc	6,88 %	06.02.2023	51.147	0,06
100.000	Northumbrian Water Finance Plc	1,63 %	11.10.2026	93.673	0,11
30.000	Northumbrian Water Finance Plc	5,63 %	29.04.2033	34.500	0,04
200.000	Northumbrian Water Finance Plc	5,13 %	23.01.2042	224.007	0,26
100.000	Notting Hill Genesis	3,75 %	20.12.2032	100.785	0,12
100.000	Notting Hill Genesis	5,25 %	07.07.2042	114.863	0,14
250.000	Notting Hill Genesis	3,25 %	12.10.2048	214.355	0,25
100.000	Peabody Capital No 2 Plc	2,75 %	02.03.2034	89.315	0,11
100.000	Peabody Capital No 2 Plc	4,63 %	12.12.2053	109.522	0,13
300.000	Pension Insurance Corp Plc	6,50 %	03.07.2024	309.606	0,37
300.000	Pension Insurance Corp Plc	5,63 %	20.09.2030	288.092	0,34
200.000	Pension Insurance Corp Plc	3,63 %	21.10.2032	157.966	0,19
100.000	Phoenix Group Holdings Plc	6,63 %	18.12.2025	103.560	0,12
510.000	Phoenix Group Holdings Plc	5,87 %	13.06.2029	512.146	0,60
100.000	Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN'	5,63 %	28.04.2031	94.654	0,11
200.000	Phoenix Group Holdings Plc FRN (Perpetual)		26.04.2028	171.182	0,20
400.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN'	4,87 %	06.05.2026	394.294	0,47
100.000	Rentokil Initial Plc 'EMTN'	5,00 %	27.06.2032	101.566	0,12
300.000	RI Finance Bonds No 3 Plc	6,13 %	13.11.2028	307.553	0,36
250.000	RL Finance Bonds NO 4 Plc FRN		07.10.2049	201.756	0,24
384.000	Rothesay Life Plc	3,38 %	12.07.2026	357.656	0,42
120.000	Rothesay Life Plc FRN		17.09.2029	120.540	0,14
400.000	Rothesay Life Plc FRN (Perpetual)		12.09.2028	375.729	0,44
400.000	Rothesay Life Plc FRN (Perpetual)		13.10.2031	298.778	0,35
170.000	Sage Group Plc/The	2,88 %	08.02.2034	146.438	0,17
110.000	Sanctuary Capital Plc	6,70 %	23.03.2039	147.304	0,17
100.000	Sanctuary Capital Plc	2,38 %	14.04.2050	74.375	0,09

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 52,56 %) (Fortsetzung)</b>					
200.000	Sanctuary Capital Plc 'EMTN'	5,00 %	26.04.2047	234.249	0,28
200.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN'	3,63 %	14.01.2026	195.260	0,23
250.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN' FRN		08.05.2026	239.255	0,28
200.000	Santander UK Group Holdings Plc 'EMTN' FRN		17.01.2029	178.331	0,21
200.000	Santander UK Plc 'EMTN'	3,88 %	15.10.2029	201.708	0,24
200.000	Scottish Hydro Electric Transmission Plc 'EMTN'	2,25 %	27.09.2035	158.032	0,19
250.000	Scottish Widows Ltd	5,50 %	16.06.2023	252.389	0,30
300.000	Scottish Widows Ltd	7,00 %	16.06.2043	320.306	0,38
320.000	Segro Plc	2,38 %	11.10.2029	292.860	0,35
100.000	Segro Plc	2,88 %	11.10.2037	84.311	0,10
60.000	Severn Trent Utilities Finance Plc	6,13 %	26.02.2024	62.780	0,07
290.000	Severn Trent Utilities Finance Plc	6,25 %	07.06.2029	336.515	0,40
300.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	3,63 %	16.01.2026	304.170	0,36
100.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	2,75 %	05.12.2031	92.080	0,11
100.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	2,00 %	02.06.2040	72.960	0,09
100.000	Severn Trent Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,88 %	24.01.2042	108.588	0,13
100.000	Sky Ltd 'EMTN'	6,00 %	21.05.2027	111.977	0,13
200.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	5,63 %	30.09.2030	225.606	0,27
200.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	6,38 %	12.11.2031	238.642	0,28
100.000	Southern Gas Networks Plc 'EMTN'	4,88 %	05.10.2023	101.983	0,12
100.000	Southern Gas Networks Plc 'EMTN'	2,50 %	03.02.2025	98.297	0,12
290.000	Southern Gas Networks Plc 'EMTN'	3,10 %	15.09.2036	243.898	0,29
400.000	SSE Plc 'EMTN'	8,38 %	20.11.2028	499.526	0,59
100.000	Standard Chartered Plc 'EMTN'	5,13 %	06.06.2034	96.386	0,11
100.000	Standard Chartered Plc 'EMTN'	4,38 %	18.01.2038	99.948	0,12
100.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN'	2,50 %	02.05.2025	95.150	0,11
200.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN'	2,75 %	27.04.2030	174.733	0,21
257.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,00 %	19.06.2025	261.910	0,31
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	3,50 %	25.02.2028	98.541	0,12
170.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	6,75 %	16.11.2028	198.089	0,23

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 52,56 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,38 %	03.07.2034	100.397	0,12
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	5,13 %	28.09.2037	106.303	0,13
150.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	2,38 %	22.04.2040	110.886	0,13
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	5,50 %	11.02.2041	111.725	0,13
250.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	7,74 %	09.04.2058	394.033	0,47
200.000	THFC Funding No 3 Plc 'EMTN'	5,20 %	11.10.2043	231.498	0,27
200.000	Unilever Plc	1,50 %	22.07.2026	189.017	0,22
200.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	2,00 %	14.02.2025	195.404	0,23
250.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	0,88 %	28.10.2029	209.326	0,25
100.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	2,63 %	12.02.2031	92.920	0,11
100.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	2,00 %	03.07.2033	84.304	0,10
100.000	United Utilities Water Finance Plc 'EMTN'	1,88 %	03.06.2042	70.637	0,08
263.000	United Utilities Water Ltd 'EMTN'	5,63 %	20.12.2027	293.272	0,35
200.000	Virgin Money UK Plc 'EMTN' FRN		25.09.2026	193.491	0,23
200.000	Virgin Money UK Plc 'EMTN' FRN		19.08.2031	173.516	0,21
150.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN		22.06.2025	145.774	0,17
100.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN		24.04.2026	95.229	0,11
239.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN		03.09.2027	228.245	0,27
200.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN		11.12.2030	193.569	0,23
80.000	Vodafone Group Plc 'EMTN'	5,90 %	26.11.2032	91.527	0,11
340.000	Vodafone Group Plc 'EMTN'	3,38 %	08.08.2049	268.597	0,32
170.000	Vodafone Group Plc 'EMTN'	3,00 %	12.08.2056	121.012	0,14
100.000	Western Power Distribution Plc	3,63 %	06.11.2023	100.381	0,12
420.000	Western Power Distribution West Midlands Plc 'EMTN'	5,75 %	16.04.2032	472.483	0,56
200.000	Whitbread Group Plc	3,38 %	16.10.2025	193.258	0,23
200.000	Yorkshire Building Society 'EMTN'	3,50 %	21.04.2026	198.810	0,23
200.000	Yorkshire Building Society FRN		11.10.2030	183.923	0,22
80.000	Yorkshire Water Finance Plc	6,38 %	19.08.2039	100.705	0,12
100.000	Yorkshire Water Finance Plc 'EMTN'	1,75 %	27.10.2032	82.669	0,10
300.000	Yorkshire Water Finance Plc 'EMTN'	2,75 %	18.04.2041	243.890	0,29
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>				<b>41.979.493</b>	<b>49,58</b>

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 17,74 %)</b>					
130.000	American Honda Finance Corp	0,75 %	25.11.2026	115.680	0,14
149.000	American Honda Finance Corp 'EMTN'	1,50 %	19.10.2027	134.644	0,16
200.000	Amgen Inc	5,50 %	07.12.2026	217.680	0,26
400.000	Amgen Inc	4,00 %	13.09.2029	409.515	0,48
100.000	Apple Inc	3,05 %	31.07.2029	100.336	0,12
250.000	Apple Inc	3,60 %	31.07.2042	249.133	0,29
270.000	AT&T Inc	2,90 %	04.12.2026	262.132	0,31
200.000	AT&T Inc	5,50 %	15.03.2027	215.243	0,25
400.000	AT&T Inc	4,38 %	14.09.2029	407.894	0,48
300.000	AT&T Inc	4,25 %	01.06.2043	277.134	0,33
350.000	AT&T Inc	4,88 %	01.06.2044	351.086	0,41
300.000	AT&T Inc 'EMTN'	7,00 %	30.04.2040	376.660	0,45
260.000	Bank of America Corp 'EMTN'	2,30 %	25.07.2025	249.773	0,30
300.000	Bank of America Corp 'EMTN'	7,00 %	31.07.2028	349.732	0,41
258.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN		02.06.2029	225.726	0,27
240.000	Bank of America Corp FRN		27.04.2031	228.235	0,27
200.000	Citigroup Inc	2,75 %	24.01.2024	197.347	0,23
100.000	Citigroup Inc	1,75 %	23.10.2026	90.798	0,11
284.000	Citigroup Inc 'EMTN'	5,15 %	21.05.2026	295.341	0,35
200.000	Citigroup Inc 'EMTN'	6,80 %	25.06.2038	257.854	0,30
50.000	Citigroup Inc 'EMTN'	7,38 %	01.09.2039	68.379	0,08
100.000	Comcast Corp	1,50 %	20.02.2029	88.558	0,10
100.000	Comcast Corp	5,50 %	23.11.2029	112.684	0,13
100.000	Comcast Corp	1,88 %	20.02.2036	78.230	0,09
100.000	Digital Stout Holding LLC	3,30 %	19.07.2029	91.081	0,11
300.000	Digital Stout Holding LLC	3,75 %	17.10.2030	277.075	0,33
250.000	Digital Stout Holding LLC 'EMTN'	4,25 %	17.01.2025	250.837	0,30
200.000	Fiserv Inc	2,25 %	01.07.2025	191.773	0,23
100.000	Fiserv Inc	3,00 %	01.07.2031	90.056	0,11
130.000	General Motors Financial Co Inc	1,55 %	30.07.2027	111.393	0,13

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 17,74 %) (Fortsetzung)</b>					
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The	6,88 %	18.01.2038	56.531	0,07
200.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	4,25 %	29.01.2026	200.499	0,24
178.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	1,50 %	07.12.2027	154.813	0,18
300.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	3,13 %	25.07.2029	278.101	0,33
141.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'	1,88 %	16.12.2030	116.023	0,14
250.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN		16.12.2025	231.003	0,27
254.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN		29.10.2029	243.807	0,29
200.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'GMTN'	7,25 %	10.04.2028	230.921	0,27
650.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN'	3,50 %	18.12.2026	643.051	0,76
200.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN		28.04.2033	164.329	0,19
250.000	JPMorgan Chase & Co FRN		28.04.2026	229.776	0,27
100.000	McDonald's Corp 'GMTN'	3,75 %	31.05.2038	94.287	0,11
170.000	MetLife Inc	5,38 %	09.12.2024	176.651	0,21
350.000	Metropolitan Life Global Funding I	0,63 %	08.12.2027	298.228	0,35
100.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	3,50 %	30.09.2026	99.814	0,12
167.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	1,63 %	12.10.2028	149.608	0,18
306.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	1,63 %	21.09.2029	268.369	0,32
200.000	Morgan Stanley 'GMTN'	2,63 %	09.03.2027	189.602	0,22
113.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	0,63 %	18.12.2025	105.237	0,12
100.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	2,13 %	04.04.2027	96.112	0,11
157.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	2,50 %	04.04.2032	145.827	0,17
100.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	1,38 %	23.06.2033	81.876	0,10
140.000	New York Life Global Funding	1,63 %	15.12.2023	136.831	0,16
133.000	New York Life Global Funding 'EMTN'	1,50 %	15.07.2027	121.051	0,14
477.000	New York Life Global Funding 'GMTN'	0,75 %	14.12.2028	402.317	0,48
100.000	Pfizer Inc	6,50 %	03.06.2038	133.170	0,16
230.000	Pfizer Inc 'REGS'	2,74 %	15.06.2043	196.148	0,23
150.000	Procter & Gamble Co/The	1,80 %	03.05.2029	139.037	0,16
300.000	Realty Income Corp	1,13 %	13.07.2027	263.070	0,31
175.000	Realty Income Corp	1,75 %	13.07.2033	135.178	0,16

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits-termin	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,75 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 17,74 %) (Fortsetzung)</b>					
330.000	Time Warner Cable LLC	5,75 %	02.06.2031	341.274	0,40
100.000	Time Warner Cable LLC	5,25 %	15.07.2042	92.255	0,11
100.000	Verizon Communications Inc	4,07 %	18.06.2024	101.492	0,12
200.000	Verizon Communications Inc	1,13 %	03.11.2028	170.743	0,20
300.000	Verizon Communications Inc	1,88 %	19.09.2030	257.908	0,30
100.000	Verizon Communications Inc	2,50 %	08.04.2031	88.619	0,10
400.000	Verizon Communications Inc	3,38 %	27.10.2036	357.427	0,42
150.000	Verizon Communications Inc	1,88 %	03.11.2038	106.747	0,13
200.000	Verizon Communications Inc 'EMTN'	4,75 %	17.02.2034	208.260	0,25
100.000	Walmart Inc	5,75 %	19.12.2030	118.269	0,14
120.000	Walmart Inc	5,63 %	27.03.2034	142.964	0,17
150.000	Walmart Inc	5,25 %	28.09.2035	174.368	0,21
50.000	Walmart Inc	4,88 %	19.01.2039	56.963	0,07
100.000	Wells Fargo & Co	4,63 %	02.11.2035	100.733	0,12
150.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,13 %	20.12.2023	146.411	0,17
100.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,00 %	28.07.2025	94.719	0,11
310.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,50 %	02.05.2029	279.779	0,33
100.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	3,50 %	12.09.2029	95.554	0,11
262.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	2,13 %	24.09.2031	217.311	0,26
50.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	4,88 %	29.11.2035	47.546	0,06
100.000	Wells Fargo Bank NA 'EMTN'	5,25 %	01.08.2023	101.090	0,12
320.000	Welltower Inc	4,80 %	20.11.2028	331.051	0,39
100.000	Welltower Inc	4,50 %	01.12.2034	97.146	0,12
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>				<b>15.881.905</b>	<b>18,76</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>82.924.022</b>	<b>97,94</b>
<b>Gesamtanlagen</b>					
Unternehmensanleihen				82.924.022	97,94
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				1.746.805	97,94
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>84.670.827</b>	<b>100,00</b>

**L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2022

	% des Gesamt- vermö- gens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	97,25
Sonstige Vermögenswerte	2,75
	<b>100,00</b>
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 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %)</b>					
<b>Argentinien (30. Juni 2021: – %)</b>					
1.800.000	Argentine Republic Government International Bond	1,00 %	09.07.2029	420.300	0,53
<b>Argentinien insgesamt</b>				<b>420.300</b>	<b>0,53</b>
<b>Armenien (30. Juni 2021: 0,45 %)</b>					
200.000	Republic of Armenia International Bond 'REGS'	7,15 %	26.03.2025	196.787	0,25
<b>Armenien insgesamt</b>				<b>196.787</b>	<b>0,25</b>
<b>Aserbaidshjan (30. Juni 2021: – %)</b>					
350.000	Republic of Azerbaijan International Bond 'REGS'	4,75 %	18.03.2024	344.816	0,43
<b>Aserbaidshjan insgesamt</b>				<b>344.816</b>	<b>0,43</b>
<b>Barbados (30. Juni 2021: – %)</b>					
400.000	Barbados Government International Bond	6,50 %	01.10.2029	385.870	0,48
<b>Summe Barbados</b>				<b>385.870</b>	<b>0,48</b>
<b>Bolivien (30. Juni 2021: 0,42 %)</b>					
500.000	Bolivian Government International Bond 'REGS'	4,50 %	20.03.2028	386.188	0,48
<b>Gesamt Bolivien</b>				<b>386.188</b>	<b>0,48</b>
<b>Brasilien (30. Juni 2021: 3,58 %)</b>					
460.000	Brazilian Government International Bond	2,63 %	05.01.2023	457.786	0,57
300.000	Brazilian Government International Bond	8,88 %	15.04.2024	327.056	0,41
800.000	Brazilian Government International Bond	4,25 %	07.01.2025	795.900	1,00
225.000	Brazilian Government International Bond	8,75 %	04.02.2025	250.988	0,32
600.000	Brazilian Government International Bond	2,88 %	06.06.2025	565.800	0,71
200.000	Brazilian Government International Bond	6,00 %	07.04.2026	207.162	0,26
200.000	Brazilian Government International Bond	10,13 %	15.05.2027	243.350	0,31
<b>Brasilien insgesamt</b>				<b>2.848.042</b>	<b>3,58</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Chile (30. Juni 2021: 0,43 %)</b>					
800.000	Chile Government International Bond	3,13 %	21.01.2026	772.400	0,97
600.000	Chile Government International Bond	2,75 %	31.01.2027	561.000	0,70
<b>Chile insgesamt</b>				<b>1.333.400</b>	<b>1,67</b>
<b>China (30. Juni 2021: 0,82 %)</b>					
400.000	China Government International Bond	1,95 %	03.12.2024	389.044	0,49
400.000	China Government International Bond 'REGS'	0,40 %	21.10.2023	387.068	0,48
<b>China insgesamt</b>				<b>776.112</b>	<b>0,97</b>
<b>Kolumbien (30. Juni 2021: 2,79 %)</b>					
200.000	Colombia Government International Bond	2,63 %	15.03.2023	196.500	0,25
600.000	Colombia Government International Bond	4,00 %	26.02.2024	583.050	0,73
235.000	Colombia Government International Bond	8,13 %	21.05.2024	243.710	0,31
700.000	Colombia Government International Bond	4,50 %	28.01.2026	656.162	0,82
200.000	Colombia Government International Bond	3,88 %	25.04.2027	176.475	0,22
<b>Kolumbien insgesamt</b>				<b>1.855.897</b>	<b>2,33</b>
<b>Costa Rica (30. Juni 2021: 0,41 %)</b>					
400.000	Costa Rica Government International Bond 'REGS'	4,25 %	26.01.2023	398.075	0,50
400.000	Costa Rica Government International Bond 'REGS'	4,38 %	30.04.2025	386.325	0,48
<b>Costa Rica insgesamt</b>				<b>784.400</b>	<b>0,98</b>
<b>Cote d'Ivoire (Elfenbeinkünste) (30. Juni 2021: – %)</b>					
250.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS'	6,38 %	03.03.2028	220.984	0,28
<b>Summe Cote d'Ivoire (Elfenbeinkünste)</b>				<b>220.984</b>	<b>0,28</b>
<b>Kroatien (30. Juni 2021: 2,56 %)</b>					
1.000.000	Croatia Government International Bond 'REGS'	5,50 %	04.04.2023	1.010.813	1,27
1.325.000	Croatia Government International Bond 'REGS'	6,00 %	26.01.2024	1.364.584	1,71
<b>Kroatien insgesamt</b>				<b>2.375.397</b>	<b>2,98</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Dominikanische Republik (30. Juni 2021: 2,03 %)</b>					
640.000	Dominican Republic International Bond 'REGS'	5,50 %	27.01.2025	634.920	0,80
775.000	Dominican Republic International Bond 'REGS'	6,88 %	29.01.2026	789.434	0,99
560.000	Dominican Republic International Bond 'REGS'	5,95 %	25.01.2027	534.730	0,67
<b>Dominikanische Republik insgesamt</b>				<b>1.959.084</b>	<b>2,46</b>
<b>Ägypten (30. Juni 2021: 2,31 %)</b>					
200.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	5,58 %	21.02.2023	196.000	0,25
410.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	6,20 %	01.03.2024	378.225	0,47
800.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	5,75 %	29.05.2024	714.000	0,90
200.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	5,88 %	11.06.2025	169.500	0,21
400.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	3,88 %	16.02.2026	291.000	0,37
200.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	7,50 %	31.01.2027	155.500	0,19
<b>Ägypten insgesamt</b>				<b>1.904.225</b>	<b>2,39</b>
<b>El Salvador (30. Juni 2021: 0,96 %)</b>					
400.000	El Salvador Government International Bond 'REGS'	7,75 %	24.01.2023	281.200	0,35
300.000	El Salvador Government International Bond 'REGS'	5,88 %	30.01.2025	108.713	0,14
300.000	El Salvador Government International Bond 'REGS'	6,38 %	18.01.2027	100.556	0,13
<b>El Salvador insgesamt</b>				<b>490.469</b>	<b>0,62</b>
<b>Gabun (30. Juni 2021: 0,85 %)</b>					
400.000	Gabon Government International Bond 'REGS'	6,95 %	16.06.2025	346.950	0,43
<b>Gabun insgesamt</b>				<b>346.950</b>	<b>0,43</b>
<b>Georgien (30. Juni 2021: – %)</b>					
200.000	Georgia Government International Bond 'REGS'	2,75 %	22.04.2026	165.788	0,21
<b>Georgien insgesamt</b>				<b>165.788</b>	<b>0,21</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Ghana (30. Juni 2021: 1,90 %)</b>					
500.000	Ghana Government International Bond 'REGS'	8,13 %	18.01.2026	358.688	0,45
400.000	Ghana Government International Bond 'REGS'	6,38 %	11.02.2027	228.000	0,29
400.000	Ghana Government International Bond 'REGS'	7,88 %	26.03.2027	232.000	0,29
200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon)	0,00 %	07.04.2025	112.037	0,14
<b>Ghana insgesamt</b>				<b>930.725</b>	<b>1,17</b>
<b>Guatemala (30. Juni 2021: 0,42 %)</b>					
200.000	Guatemala Government Bond 'REGS'	4,50 %	03.05.2026	192.162	0,24
<b>Guatemala insgesamt</b>				<b>192.162</b>	<b>0,24</b>
<b>Ungarn (30. Juni 2021: 4,33 %)</b>					
480.000	Hungary Government International Bond	5,38 %	21.02.2023	485.490	0,61
850.000	Hungary Government International Bond	5,75 %	22.11.2023	867.425	1,09
884.000	Hungary Government International Bond	5,38 %	25.03.2024	901.570	1,13
<b>Ungarn insgesamt</b>				<b>2.254.485</b>	<b>2,83</b>
<b>Indien (30. Juni 2021: – %)</b>					
300.000	Export-Import Bank of India 'REGS'	3,38 %	05.08.2026	285.908	0,36
<b>Indien insgesamt</b>				<b>285.908</b>	<b>0,36</b>
<b>Indonesien (30. Juni 2021: 3,49 %)</b>					
400.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'	3,38 %	15.04.2023	400.044	0,50
400.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'	5,88 %	15.01.2024	411.450	0,52
400.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'	4,13 %	15.01.2025	398.575	0,50
200.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'	4,75 %	08.01.2026	202.225	0,25
200.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'	3,85 %	18.07.2027	195.787	0,25
<b>Indonesien insgesamt</b>				<b>1.608.081</b>	<b>2,02</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Jamaica (30. Juni 2021: – %)</b>					
880.000	Jamaica Government International Bond	6,75 %	28.04.2028	906.565	1,14
<b>Summe Jamaica</b>				<b>906.565</b>	<b>1,14</b>
<b>Jordanien (30. Juni 2021: 0,43 %)</b>					
400.000	Jordan Government International Bond 'REGS'	4,95 %	07.07.2025	360.450	0,45
200.000	Jordan Government International Bond 'REGS'	6,13 %	29.01.2026	182.850	0,23
510.000	Jordan Government International Bond 'REGS'	5,75 %	31.01.2027	447.461	0,56
<b>Jordanien insgesamt</b>				<b>990.761</b>	<b>1,24</b>
<b>Kasachstan (30. Juni 2021: 2,26 %)</b>					
840.000	Kazakhstan Government International Bond 'REGS'	3,88 %	14.10.2024	846.720	1,06
745.000	Kazakhstan Government International Bond 'REGS'	5,13 %	21.07.2025	768.887	0,97
<b>Kasachstan insgesamt</b>				<b>1.615.607</b>	<b>2,03</b>
<b>Kenia (30. Juni 2021: 0,90 %)</b>					
610.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS'	6,88 %	24.06.2024	512.400	0,64
200.000	Republic of Kenya Government International Bond 'REGS'	7,00 %	22.05.2027	147.000	0,19
<b>Kenia insgesamt</b>				<b>659.400</b>	<b>0,83</b>
<b>Kuwait (30. Juni 2021: – %)</b>					
1.950.000	Kuwait International Government Bond 'REGS'	3,50 %	20.03.2027	1.941.834	2,44
<b>Kuwait insgesamt</b>				<b>1.941.834</b>	<b>2,44</b>
<b>Mexiko (30. Juni 2021: 1,00 %)</b>					
600.000	Mexico Government International Bond	4,13 %	21.01.2026	600.300	0,75
400.000	Mexico Government International Bond	4,15 %	28.03.2027	394.200	0,50
<b>Mexiko insgesamt</b>				<b>994.500</b>	<b>1,25</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Mongolei (30. Juni 2021: 2,21 %)</b>					
200.000	Development Bank of Mongolia LLC 'REGS'	7,25 %	23.10.2023	193.100	0,24
225.000	Mongolia Government International Bond 'REGS'	5,63 %	01.05.2023	221.245	0,28
400.000	Mongolia Government International Bond 'REGS'	8,75 %	09.03.2024	401.825	0,50
400.000	Mongolia Government International Bond 'REGS'	5,13 %	07.04.2026	356.044	0,45
<b>Mongolei insgesamt</b>				<b>1.172.214</b>	<b>1,47</b>
<b>Marokko (30. Juni 2021: 0,50 %)</b>					
640.000	Morocco Government International Bond 'REGS'	4,25 %	11.12.2022	638.320	0,80
<b>Marokko insgesamt</b>				<b>638.320</b>	<b>0,80</b>
<b>Namibia (30. Juni 2021: 0,43 %)</b>					
400.000	Namibia International Bonds 'REGS'	5,25 %	29.10.2025	347.000	0,44
<b>Namibia insgesamt</b>				<b>347.000</b>	<b>0,44</b>
<b>Oman (30. Juni 2021: 5,29 %)</b>					
200.000	Oman Government International Bond 'REGS'	4,13 %	17.01.2023	199.500	0,25
600.000	Oman Government International Bond 'REGS'	4,88 %	01.02.2025	586.500	0,74
800.000	Oman Government International Bond 'REGS'	4,75 %	15.06.2026	760.000	0,95
200.000	Oman Government International Bond 'REGS'	5,38 %	08.03.2027	193.750	0,24
475.000	Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS'	4,40 %	01.06.2024	466.687	0,59
850.000	Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS'	5,93 %	31.10.2025	867.000	1,09
<b>Oman insgesamt</b>				<b>3.073.437</b>	<b>3,86</b>
<b>Panama (30. Juni 2021: 2,77 %)</b>					
460.000	Panama Government International Bond	4,00 %	22.09.2024	459.080	0,58
895.000	Panama Government International Bond	3,75 %	16.03.2025	884.260	1,11
450.000	Panama Government International Bond	7,13 %	29.01.2026	487.772	0,61
<b>Panama insgesamt</b>				<b>1.831.112</b>	<b>2,30</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Paraguay (30. Juni 2021: 0,68 %)</b>					
260.000	Paraguay Government International Bond 'REGS'	5,00 %	15.04.2026	255.255	0,32
200.000	Paraguay Government International Bond 'REGS'	4,70 %	27.03.2027	191.850	0,24
<b>Paraguay insgesamt</b>				<b>447.105</b>	<b>0,56</b>
<b>Peru (30. Juni 2021: 1,93 %)</b>					
300.000	Fondo MIVIVIENDA SA 'REGS'	4,63 %	12.04.2027	289.650	0,37
725.000	Peruvian Government International Bond	7,35 %	21.07.2025	782.230	0,98
420.000	Peruvian Government International Bond	2,39 %	23.01.2026	390.285	0,49
<b>Peru insgesamt</b>				<b>1.462.165</b>	<b>1,84</b>
<b>Philippinen (30. Juni 2021: 2,67 %)</b>					
735.000	Philippine Government International Bond	4,20 %	21.01.2024	740.593	0,93
200.000	Philippine Government International Bond	7,50 %	25.09.2024	208.772	0,26
660.000	Philippine Government International Bond	10,63 %	16.03.2025	775.573	0,97
225.000	Philippine Government International Bond	5,50 %	30.03.2026	235.150	0,30
400.000	Philippine Government International Bond	3,23 %	29.03.2027	386.044	0,49
<b>Philippinen insgesamt</b>				<b>2.346.132</b>	<b>2,95</b>
<b>Polen (30. Juni 2021: 4,40 %)</b>					
1.370.000	Republic of Poland Government International Bond	3,00 %	17.03.2023	1.364.691	1,72
1.580.000	Republic of Poland Government International Bond	4,00 %	22.01.2024	1.579.309	1,98
1.250.000	Republic of Poland Government International Bond	3,25 %	06.04.2026	1.211.953	1,52
<b>Polen insgesamt</b>				<b>4.155.953</b>	<b>5,22</b>
<b>Katar (30. Juni 2021: 2,84 %)</b>					
780.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,88 %	23.04.2023	782.730	0,98
820.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,38 %	14.03.2024	815.900	1,03

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Katar (30. Juni 2021: 2,84 %) (Fortsetzung)</b>					
505.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,40 %	16.04.2025	501.212	0,63
600.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,25 %	02.06.2026	591.750	0,74
<b>Katar insgesamt</b>				<b>2.691.592</b>	<b>3,38</b>
<b>Rumänien (30. Juni 2021: 3,15 %)</b>					
1.210.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	4,38 %	22.08.2023	1.207.202	1,52
236.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	4,88 %	22.01.2024	235.410	0,30
600.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	3,00 %	27.02.2027	529.050	0,66
<b>Rumänien insgesamt</b>				<b>1.971.662</b>	<b>2,48</b>
<b>Saudi-Arabien (30. Juni 2021: 2,57 %)</b>					
530.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	2,88 %	04.03.2023	528.012	0,66
940.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	4,00 %	17.04.2025	944.700	1,19
625.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	2,90 %	22.10.2025	607.031	0,76
1.050.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	3,25 %	26.10.2026	1.025.063	1,29
<b>Saudi-Arabien insgesamt</b>				<b>3.104.806</b>	<b>3,90</b>
<b>Südafrika (30. Juni 2021: 2,38 %)</b>					
510.000	Republic of South Africa Government International Bond	4,67 %	17.01.2024	505.952	0,63
1.050.000	Republic of South Africa Government International Bond	5,88 %	16.09.2025	1.040.025	1,31
400.000	Republic of South Africa Government International Bond	4,88 %	14.04.2026	378.700	0,48
<b>Südafrika insgesamt</b>				<b>1.924.677</b>	<b>2,42</b>
<b>Sri Lanka (30. Juni 2021: 1,89 %)</b>					
200.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	5,75 %	18.04.2023	62.163	0,08
625.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	6,85 %	14.03.2024	175.069	0,22

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Sri Lanka (30. Juni 2021: 1,89 %) (Fortsetzung)</b>					
400.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	6,13 %	03.06.2025	129.700	0,16
300.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	6,85 %	03.11.2025	90.033	0,11
350.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	6,83 %	18.07.2026	114.909	0,15
<b>Sri Lanka insgesamt</b>				<b>571.874</b>	<b>0,72</b>
<b>Surinam (30. Juni 2021: – %)</b>					
200.000	Suriname Government International Bond 'REGS'	9,25 %	26.10.2026	141.475	0,18
<b>Surinam insgesamt</b>				<b>141.475</b>	<b>0,18</b>
<b>Tadschikistan (30. Juni 2021: – %)</b>					
200.000	Republic of Tajikistan International Bond 'REGS'	7,13 %	14.09.2027	123.037	0,15
<b>Summe Tadschikistan</b>				<b>123.037</b>	<b>0,15</b>
<b>Trinidad und Tobago (30. Juni 2021: 0,42 %)</b>					
200.000	Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS'	4,38 %	16.01.2024	196.537	0,25
525.000	Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS'	4,50 %	04.08.2026	494.747	0,62
<b>Trinidad und Tobago insgesamt</b>				<b>691.284</b>	<b>0,87</b>
<b>Tunesien (30. Juni 2021: 0,37 %)</b>					
600.000	Tunisian Republic 'REGS'	5,75 %	30.01.2025	328.050	0,41
<b>Tunesien insgesamt</b>				<b>328.050</b>	<b>0,41</b>
<b>Türkei (30. Juni 2021: 3,27 %)</b>					
400.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS'	5,00 %	06.04.2023	391.200	0,49
200.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS'	5,13 %	22.06.2026	178.288	0,22
800.000	Turkey Government International Bond	5,75 %	22.03.2024	740.900	0,93

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Türkei (30. Juni 2021: 3,27 %) (Fortsetzung)</b>					
360.000	Turkey Government International Bond	7,38 %	05.02.2025	333.967	0,42
250.000	Turkey Government International Bond	6,38 %	14.10.2025	220.750	0,28
400.000	Turkey Government International Bond	4,75 %	26.01.2026	330.000	0,42
400.000	Turkey Government International Bond	4,88 %	09.10.2026	319.825	0,40
400.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS 'REGS'	5,75 %	06.07.2026	335.200	0,42
<b>Türkei insgesamt</b>				<b>2.850.130</b>	<b>3,58</b>
<b>Ukraine (30. Juni 2021: 2,76 %)</b>					
700.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	7,75 %	01.09.2023	217.000	0,27
250.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	8,99 %	01.02.2024	62.500	0,08
320.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	7,75 %	01.09.2024	80.000	0,10
420.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	7,75 %	01.09.2025	103.950	0,13
225.000	Ukraine Government International Bond 'REGS'	7,75 %	01.09.2026	56.813	0,07
<b>Ukraine insgesamt</b>				<b>520.263</b>	<b>0,65</b>
<b>Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2021: 3,80 %)</b>					
450.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	0,75 %	02.09.2023	435.460	0,55
675.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	2,13 %	30.09.2024	652.134	0,82
690.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	2,50 %	16.04.2025	670.292	0,84
400.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	3,13 %	03.05.2026	392.200	0,49
<b>Vereinigte Arabische Emirate insgesamt</b>				<b>2.150.086</b>	<b>2,70</b>
<b>Uruguay (30. Juni 2021: 0,89 %)</b>					
600.000	Uruguay Government International Bond	4,50 %	14.08.2024	606.112	0,76
955.000	Uruguay Government International Bond	4,38 %	27.10.2027	965.923	1,21
<b>Uruguay insgesamt</b>				<b>1.572.035</b>	<b>1,97</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 85,14 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Usbekistan (30. Juni 2021: 0,43 %)</b>					
200.000	Republic of Uzbekistan International Bond 'REGS'	4,75 %	20.02.2024	190.663	0,24
<b>Usbekistan insgesamt</b>				<b>190.663</b>	<b>0,24</b>
<b>Usbekistan (30. Juni 2021: 0,44 %)</b>					
550.000	Vietnam Government International Bond 'REGS'	4,80 %	19.11.2024	547.181	0,69
<b>Vietnam insgesamt</b>				<b>547.181</b>	<b>0,69</b>
<b>Sambia (30. Juni 2021: 0,29 %)</b>					
425.000	Zambia Government International Bond 'REGS'	8,50 %	14.04.2024	255.000	0,32
450.000	Zambia Government International Bond 'REGS'	8,97 %	30.07.2027	261.506	0,33
<b>Sambia insgesamt</b>				<b>516.506</b>	<b>0,65</b>
<b>Staatsanleihe insgesamt</b>				<b>64.543.497</b>	<b>81,05</b>
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 13,57 %)</b>					
<b>Aserbaidtschan (30. Juni 2021: 1,17 %)</b>					
600.000	Southern Gas Corridor CJSC 'REGS'	6,88 %	24.03.2026	589.302	0,74
<b>Aserbaidtschan insgesamt</b>				<b>589.302</b>	<b>0,74</b>
<b>Bahrain (30. Juni 2021: 2,02 %)</b>					
470.000	CBB International Sukuk Co 5 Spc 'REGS'	5,62 %	12.02.2024	469.794	0,59
200.000	CBB International Sukuk Co 6 Spc 'REGS'	5,25 %	20.03.2025	197.662	0,25
400.000	CBB International Sukuk Co 7 SPC 'REGS'	6,88 %	05.10.2025	416.075	0,52
650.000	CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS'	6,25 %	14.11.2024	659.466	0,83
650.000	CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS'	4,50 %	30.03.2027	623.513	0,78
<b>Bahrain insgesamt</b>				<b>2.366.510</b>	<b>2,97</b>
<b>Britische Jungferninseln (30. Juni 2021: 0,49 %)</b>					
280.000	Sinochem Offshore Capital Co Ltd 'EMTN'	1,63 %	29.10.2025	257.930	0,32
<b>Britische Jungferninseln insgesamt</b>				<b>257.930</b>	<b>0,32</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 13,57 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 1,10 %)</b>					
150.000	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais 'REGS'	5,33 %	15.02.2028	147.028	0,18
200.000	DP World Crescent Ltd 'REGS'	3,91 %	31.05.2023	199.610	0,25
600.000	KSA Sukuk Ltd 'REGS'	3,63 %	20.04.2027	593.250	0,75
200.000	Maldives Sukuk Issuance Ltd 'REGS'	9,88 %	08.04.2026	150.710	0,19
200.000	Mumtalakat Sukuk Holding Co	5,63 %	27.02.2024	203.804	0,26
200.000	Mumtalakat Sukuk Holding Co	4,10 %	21.01.2027	193.750	0,24
400.000	RAK Capital 'EMTN'	3,09 %	31.03.2025	387.825	0,49
500.000	Sharjah Sukuk Program Ltd 'EMTN'	3,85 %	03.04.2026	495.094	0,62
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>				<b>2.371.071</b>	<b>2,98</b>
<b>Chile (30. Juni 2021: 1,48 %)</b>					
400.000	Banco del Estado de Chile 'REGS'	2,70 %	09.01.2025	378.200	0,48
200.000	Empresa Nacional del Petroleo 'REGS'	3,75 %	05.08.2026	184.975	0,23
<b>Chile insgesamt</b>				<b>563.175</b>	<b>0,71</b>
<b>Indonesien (30. Juni 2021: 0,84 %)</b>					
200.000	Pelabuhan Indonesia Persero PT 'REGS'	4,25 %	05.05.2025	196.522	0,25
400.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	4,35 %	10.09.2024	403.075	0,51
600.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	4,33 %	28.05.2025	602.363	0,76
210.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	4,55 %	29.03.2026	211.286	0,26
450.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS'	4,15 %	29.03.2027	442.350	0,55
<b>Indonesien insgesamt</b>				<b>1.855.596</b>	<b>2,33</b>
<b>Kasachstan (30. Juni 2021: 0,90 %)</b>					
200.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS'	5,75 %	12.05.2025	199.100	0,25
400.000	Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC 'REGS'	2,00 %	28.10.2026	344.230	0,43
600.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	4,75 %	24.04.2025	560.737	0,70
200.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS'	4,75 %	19.04.2027	174.100	0,22
<b>Kasachstan insgesamt</b>				<b>1.278.167</b>	<b>1,60</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 13,57 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Malaysia (30. Juni 2021: 1,34 %)</b>					
600.000	Malaysia Sovereign Sukuk Bhd 'REGS'	3,04 %	22.04.2025	592.800	0,74
250.000	Malaysia Sukuk Global Bhd 'REGS'	3,18 %	27.04.2026	247.860	0,31
200.000	Petroliam Nasional Bhd 'REGS'	7,63 %	15.10.2026	229.400	0,29
350.000	Petronas Capital Ltd 'REGS'	3,50 %	18.03.2025	347.331	0,44
<b>Malaysia insgesamt</b>				<b>1.417.391</b>	<b>1,78</b>
<b>Mexiko (30. Juni 2021: 0,39 %)</b>					
200.000	Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/Cayman Islands 'REGS'	4,38 %	14.10.2025	197.850	0,25
<b>Mexiko insgesamt</b>				<b>197.850</b>	<b>0,25</b>
<b>Philippinen (30. Juni 2021: 0,91 %)</b>					
400.000	Power Sector Assets & Liabilities Management Corp 'REGS'	7,39 %	02.12.2024	428.325	0,54
<b>Philippinen insgesamt</b>				<b>428.325</b>	<b>0,54</b>
<b>Katar (30. Juni 2021: 0,47 %)</b>					
400.000	Qatar Energy 'REGS'	1,38 %	12.09.2026	361.100	0,45
200.000	SoQ Sukuk A QSC	3,24 %	18.01.2023	200.150	0,25
<b>Katar insgesamt</b>				<b>561.250</b>	<b>0,70</b>
<b>Trinidad und Tobago (30. Juni 2021: – %)</b>					
350.000	Trinidad Generation UnLtd 'REGS'	5,25 %	04.11.2027	335.563	0,42
<b>Trinidad und Tobago insgesamt</b>				<b>335.563</b>	<b>0,42</b>
<b>Ukraine (30. Juni 2021: – %)</b>					
650.000	NPC Ukrenergo 'REGS'	6,88 %	09.11.2026	156.000	0,20
<b>Ukraine insgesamt</b>				<b>156.000</b>	<b>0,20</b>
<b>Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2021: – %)</b>					
200.000	DAE Sukuk Dific Ltd 'REGS'	3,75 %	15.02.2026	188.475	0,24

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 13,57 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2021: – %) (Fortsetzung)</b>					
400.000	Emirates Development Bank PJSC 'EMTN'	3,52 %	06.03.2024	398.000	0,50
200.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'GMTN'	2,50 %	21.05.2026	189.225	0,24
600.000	MDGH GMTN RSC Ltd 'REGS'	2,50 %	07.11.2024	582.487	0,73
<b>Vereinigte Arabische Emirate insgesamt</b>				<b>1.358.187</b>	<b>1,71</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: – %)</b>					
200.000	Ukraine Railways Via Rail Capital Markets Plc	8,25 %	09.07.2024	55.020	0,07
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>				<b>55.020</b>	<b>0,07</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>13.791.337</b>	<b>17,31</b>
<b>Gesamtanlagen</b>					
Staatsanleihe				64.543.497	81,05
Unternehmensanleihen				13.791.337	17,31
Anzahl der Kontrakte	Käufe	Verkäufe	Fälligkeits-termin	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettover-mögens
<b>Devisenterminkontrakte<sup>1</sup></b>					
2	117.520 US\$	(112.321) €	01.07.2022	93	0,00
3	1.089.783 EUR	USD(1.136.207)	01.07.2022	3.110	0,00
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (30. Juni 2021: – %)</b>				<b>3.203</b>	<b>0,00</b>
Anzahl der Kontrakte	Käufe	Verkäufe	Fälligkeits-termin	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover-mögens
2	USD262.056	(251.556) €	01.07.2022	(933)	(0,00)
1	6.466.991 EUR	USD(6.855.974)	02.08.2022	(81.668)	(0,10)
3	5.741.227 EUR	USD(6.149.999)	01.07.2022	(147.819)	(0,19)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (30. Juni 2021: – %)</b>				<b>(230.420)</b>	<b>(0,29)</b>
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten*				1.531.014	1,93
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>79.638.631</b>	<b>100,00</b>

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	95,30
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,00
Sonstige Vermögenswerte	4,70
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

<sup>1</sup>Der 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 315.498 US\$ enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

## L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 98,44 %)</b>					
<b>China (30. Juni 2021: 98,44 %)</b>					
3.500.000	Agricultural Development Bank of China	3,28 %	26.02.2023	526.901	0,20
8.930.000	Agricultural Development Bank of China	2,20 %	01.04.2023	1.335.529	0,52
5.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,54 %	22.04.2023	755.563	0,29
6.350.000	Agricultural Development Bank of China	4,37 %	25.05.2023	968.124	0,37
5.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,06 %	05.08.2023	754.249	0,29
9.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,55 %	21.11.2023	1.368.428	0,53
9.100.000	Agricultural Development Bank of China	3,83 %	06.01.2024	1.389.280	0,54
7.700.000	Agricultural Development Bank of China	3,19 %	03.03.2024	1.165.526	0,45
4.800.000	Agricultural Development Bank of China	3,51 %	03.04.2024	730.743	0,28
6.000.000	Agricultural Development Bank of China	2,78 %	21.07.2024	901.932	0,35
11.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,24 %	14.08.2024	1.668.878	0,65
10.300.000	Agricultural Development Bank of China	4,98 %	12.01.2025	1.627.464	0,63
4.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,97 %	27.02.2025	618.152	0,24
11.700.000	Agricultural Development Bank of China	2,25 %	22.04.2025	1.730.503	0,67
8.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,45 %	23.09.2025	1.222.553	0,47
7.350.000	Agricultural Development Bank of China	4,00 %	12.11.2025	1.141.761	0,44
10.120.000	Agricultural Development Bank of China	3,33 %	06.01.2026	1.539.801	0,60
7.500.000	Agricultural Development Bank of China	3,37 %	26.02.2026	1.142.250	0,44
6.500.000	Agricultural Development Bank of China	3,35 %	24.03.2026	989.947	0,38
11.750.000	Agricultural Development Bank of China	3,58 %	22.04.2026	1.803.421	0,70
12.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,63 %	19.07.2026	1.846.732	0,71
7.000.000	Agricultural Development Bank of China	2,99 %	11.08.2026	1.051.730	0,41
12.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,85 %	06.01.2027	1.862.992	0,72
3.500.000	Agricultural Development Bank of China	2,74 %	23.02.2027	519.636	0,20
11.800.000	Agricultural Development Bank of China	4,39 %	08.09.2027	1.883.018	0,73
8.500.000	Agricultural Development Bank of China	3,48 %	04.02.2028	1.302.112	0,50
12.400.000	Agricultural Development Bank of China	4,65 %	11.05.2028	2.015.153	0,78
5.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,19 %	12.08.2028	752.336	0,29
10.640.000	Agricultural Development Bank of China	3,75 %	25.01.2029	1.654.293	0,64
4.800.000	Agricultural Development Bank of China	2,91 %	21.02.2029	709.520	0,27

## L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>China (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
15.700.000	Agricultural Development Bank of China	3,74 %	12.07.2029	2.444.882	0,95
16.200.000	Agricultural Development Bank of China	2,96 %	17.04.2030	2.394.759	0,93
13.500.000	Agricultural Development Bank of China	3,79 %	26.10.2030	2.113.662	0,82
14.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,52 %	24.05.2031	2.153.306	0,83
12.700.000	Agricultural Development Bank of China	3,30 %	05.11.2031	1.923.076	0,74
7.000.000	China Development Bank	3,24 %	25.02.2023	1.053.545	0,41
4.200.000	China Development Bank	4,69 %	23.03.2023	639.320	0,25
3.350.000	China Development Bank	1,86 %	09.04.2023	499.726	0,19
7.000.000	China Development Bank	3,00 %	07.08.2023	1.055.629	0,41
8.500.000	China Development Bank	3,76 %	14.08.2023	1.292.628	0,50
5.500.000	China Development Bank	2,98 %	08.01.2024	829.745	0,32
2.800.000	China Development Bank	3,85 %	09.01.2024	427.714	0,17
3.000.000	China Development Bank	5,90 %	20.01.2024	472.180	0,18
6.790.000	China Development Bank	3,30 %	01.02.2024	1.029.730	0,40
7.700.000	China Development Bank	3,42 %	02.07.2024	1.172.453	0,45
8.600.000	China Development Bank	4,30 %	21.08.2024	1.332.659	0,52
9.500.000	China Development Bank	3,23 %	10.01.2025	1.441.905	0,56
4.100.000	China Development Bank	3,81 %	05.02.2025	630.597	0,24
2.100.000	China Development Bank	4,73 %	02.04.2025	331.135	0,13
6.000.000	China Development Bank	4,21 %	13.04.2025	933.939	0,36
4.000.000	China Development Bank	2,89 %	22.06.2025	601.877	0,23
10.200.000	China Development Bank	3,34 %	14.07.2025	1.554.015	0,60
9.380.000	China Development Bank	3,74 %	10.09.2025	1.445.276	0,56
1.000.000	China Development Bank	4,15 %	26.10.2025	156.095	0,06
6.000.000	China Development Bank	3,68 %	26.02.2026	924.068	0,36
12.500.000	China Development Bank	3,30 %	03.03.2026	1.902.372	0,74
9.050.000	China Development Bank	3,18 %	05.04.2026	1.369.742	0,53
6.000.000	China Development Bank	3,50 %	13.08.2026	918.484	0,36
8.800.000	China Development Bank	3,05 %	25.08.2026	1.324.058	0,51
4.100.000	China Development Bank	2,83 %	10.09.2026	612.946	0,24
4.470.000	China Development Bank	3,43 %	14.01.2027	683.080	0,26
4.000.000	China Development Bank	2,65 %	24.02.2027	593.871	0,23

## L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>China (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
8.500.000	China Development Bank	4,04 %	10.04.2027	1.333.341	0,52
2.500.000	China Development Bank	3,39 %	10.07.2027	381.737	0,15
6.500.000	China Development Bank	4,24 %	24.08.2027	1.031.039	0,40
4.000.000	China Development Bank	3,40 %	08.01.2028	610.575	0,24
9.900.000	China Development Bank	4,88 %	09.02.2028	1.622.948	0,63
13.500.000	China Development Bank	4,04 %	06.07.2028	2.130.776	0,82
1.000.000	China Development Bank	3,09 %	09.08.2028	149.989	0,06
9.100.000	China Development Bank	3,48 %	08.01.2029	1.393.700	0,54
8.500.000	China Development Bank	3,65 %	21.05.2029	1.315.563	0,51
9.950.000	China Development Bank	3,45 %	20.09.2029	1.522.355	0,59
8.600.000	China Development Bank	3,07 %	10.03.2030	1.282.681	0,50
11.600.000	China Development Bank	3,09 %	18.06.2030	1.731.686	0,67
11.700.000	China Development Bank	3,70 %	20.10.2030	1.821.516	0,70
12.000.000	China Development Bank	3,66 %	01.03.2031	1.864.349	0,72
11.000.000	China Development Bank	3,41 %	07.06.2031	1.678.997	0,65
8.500.000	China Development Bank	3,12 %	13.09.2031	1.269.199	0,49
9.400.000	China Development Bank	3,00 %	17.01.2032	1.390.110	0,54
3.200.000	China Development Bank	2,98 %	22.04.2032	475.127	0,18
15.700.000	China Government Bond	2,24 %	05.03.2023	2.350.930	0,91
7.700.000	China Government Bond	2,75 %	17.03.2023	1.157.823	0,45
16.600.000	China Government Bond	3,17 %	19.04.2023	2.506.749	0,97
9.700.000	China Government Bond	2,95 %	16.06.2023	1.461.488	0,57
23.300.000	China Government Bond	2,36 %	02.07.2023	3.492.383	1,35
10.000.000	China Government Bond	3,30 %	12.07.2023	1.514.643	0,59
9.500.000	China Government Bond	2,75 %	01.09.2023	1.429.599	0,55
13.800.000	China Government Bond	3,29 %	18.10.2023	2.094.635	0,81
25.500.000	China Government Bond	2,88 %	05.11.2023	3.846.263	1,49
7.500.000	China Government Bond	3,20 %	16.03.2024	1.139.076	0,44
11.300.000	China Government Bond	4,42 %	20.03.2024	1.762.744	0,68
22.000.000	China Government Bond	2,84 %	08.04.2024	3.321.256	1,28

## L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>China (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
24.700.000	China Government Bond	3,19 %	11.04.2024	3.752.664	1,45
5.000.000	China Government Bond	4,00 %	19.06.2024	775.283	0,30
9.800.000	China Government Bond	3,57 %	22.06.2024	1.503.543	0,58
26.800.000	China Government Bond	2,47 %	02.09.2024	4.016.243	1,55
8.500.000	China Government Bond	4,13 %	18.09.2024	1.328.154	0,51
9.550.000	China Government Bond	3,69 %	21.09.2024	1.473.001	0,57
18.540.000	China Government Bond	2,94 %	17.10.2024	2.808.310	1,09
9.000.000	China Government Bond	3,90 %	21.12.2024	1.399.371	0,54
17.100.000	China Government Bond	2,26 %	24.02.2025	2.545.016	0,98
11.400.000	China Government Bond	3,77 %	08.03.2025	1.769.945	0,68
25.900.000	China Government Bond	1,99 %	09.04.2025	3.822.575	1,48
8.300.000	China Government Bond	3,61 %	07.06.2025	1.285.144	0,50
11.200.000	China Government Bond	3,60 %	06.09.2025	1.735.485	0,67
9.000.000	China Government Bond	2,99 %	15.10.2025	1.364.552	0,53
28.920.000	China Government Bond	3,02 %	22.10.2025	4.392.489	1,70
17.100.000	China Government Bond	3,22 %	06.12.2025	2.615.352	1,01
6.600.000	China Government Bond	2,85 %	28.01.2026	993.936	0,38
24.800.000	China Government Bond	3,03 %	11.03.2026	3.769.698	1,46
9.300.000	China Government Bond	2,90 %	05.05.2026	1.406.470	0,54
28.200.000	China Government Bond	3,25 %	06.06.2026	4.325.858	1,67
8.500.000	China Government Bond	2,74 %	04.08.2026	1.278.250	0,49
28.200.000	China Government Bond	2,69 %	12.08.2026	4.228.839	1,64
5.800.000	China Government Bond	2,70 %	03.11.2026	867.386	0,34
22.900.000	China Government Bond	3,12 %	05.12.2026	3.496.924	1,35
16.000.000	China Government Bond	2,37 %	20.01.2027	2.363.398	0,91
5.500.000	China Government Bond	3,40 %	09.02.2027	850.858	0,33
10.500.000	China Government Bond	2,48 %	15.04.2027	1.558.781	0,60
8.500.000	China Government Bond	3,52 %	04.05.2027	1.326.051	0,51
26.000.000	China Government Bond	2,85 %	04.06.2027	3.920.575	1,52
11.500.000	China Government Bond	3,59 %	03.08.2027	1.801.094	0,70
7.500.000	China Government Bond	3,82 %	02.11.2027	1.193.033	0,46
25.000.000	China Government Bond	3,28 %	03.12.2027	3.852.054	1,49

## L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>China (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
9.000.000	China Government Bond	3,85 %	01.02.2028	1.436.757	0,56
28.000.000	China Government Bond	3,01 %	13.05.2028	4.239.796	1,64
13.000.000	China Government Bond	3,69 %	17.05.2028	2.056.871	0,80
9.000.000	China Government Bond	3,54 %	16.08.2028	1.411.127	0,55
21.500.000	China Government Bond	2,91 %	14.10.2028	3.231.685	1,25
13.550.000	China Government Bond	3,25 %	22.11.2028	2.079.426	0,80
18.000.000	China Government Bond	2,80 %	24.03.2029	2.686.946	1,04
24.300.000	China Government Bond	3,29 %	23.05.2029	3.747.035	1,45
24.500.000	China Government Bond	3,13 %	21.11.2029	3.727.521	1,44
23.160.000	China Government Bond	2,68 %	21.05.2030	3.409.822	1,32
34.450.000	China Government Bond	3,27 %	19.11.2030	5.301.570	2,05
25.300.000	China Government Bond	3,02 %	27.05.2031	3.818.992	1,48
14.700.000	China Government Bond	2,89 %	18.11.2031	2.197.649	0,85
20.400.000	China Government Bond	2,75 %	17.02.2032	3.018.787	1,17
5.700.000	China Government Bond	2,76 %	15.05.2032	847.155	0,33
3.400.000	Export-Import Bank of China/The	2,17 %	07.04.2023	508.460	0,20
3.500.000	Export-Import Bank of China/The	4,37 %	19.06.2023	534.356	0,21
5.000.000	Export-Import Bank of China/The	3,34 %	04.09.2023	757.358	0,29
9.900.000	Export-Import Bank of China/The	3,28 %	11.02.2024	1.499.391	0,58
5.000.000	Export-Import Bank of China/The	3,14 %	02.04.2024	756.392	0,29
4.190.000	Export-Import Bank of China/The	2,93 %	02.03.2025	631.132	0,24
2.750.000	Export-Import Bank of China/The	4,29 %	07.04.2025	428.911	0,17
5.100.000	Export-Import Bank of China/The	3,87 %	14.09.2025	788.422	0,31
3.800.000	Export-Import Bank of China/The	3,43 %	23.10.2025	580.261	0,22
6.400.000	Export-Import Bank of China/The	3,33 %	22.02.2026	973.684	0,38
6.900.000	Export-Import Bank of China/The	3,22 %	14.05.2026	1.045.766	0,40
7.200.000	Export-Import Bank of China/The	3,18 %	05.09.2026	1.088.706	0,42
3.350.000	Export-Import Bank of China/The	3,26 %	24.02.2027	508.330	0,20
1.500.000	Export-Import Bank of China/The	4,11 %	20.03.2027	235.785	0,09
2.270.000	Export-Import Bank of China/The	4,89 %	26.03.2028	372.588	0,14
7.000.000	Export-Import Bank of China/The	3,86 %	20.05.2029	1.096.563	0,42

## L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Netto- ver- mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>China (30. Juni 2021: 98,44 %) (Fortsetzung)</b>					
8.300.000	Export-Import Bank of China/The	3,23 %	23.03.2030	1.248.873	0,48
6.300.000	Export-Import Bank of China/The	3,74 %	16.11.2030	983.501	0,38
7.000.000	Export-Import Bank of China/The	3,38 %	16.07.2031	1.065.178	0,41
4.100.000	Export-Import Bank of China/The	3,18 %	11.03.2032	614.133	0,24
<b>China insgesamt</b>				255.069.539	98,66
<b>Staatsanleihe insgesamt</b>				255.069.539	98,66
<b>Gesamtanlagen</b>					
Staatsanleihe				255.069.539	98,66
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				3.455.652	1,34
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>258.525.191</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					<b>% des Gesamtvermögens</b>
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					97,70
Sonstige Vermögenswerte					2,30
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

## L&amp;G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert £	% des Nettover-mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 99,48 %)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 99,48 %)</b>					
1.690.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2023	1.675.905	7,74
1.670.000	United Kingdom Gilt	0,75 %	22.07.2023	1.650.720	7,63
1.714.000	United Kingdom Gilt	2,25 %	07.09.2023	1.719.725	7,94
1.705.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2024	1.657.328	7,66
1.696.000	United Kingdom Gilt	1,00 %	22.04.2024	1.669.949	7,71
1.682.000	United Kingdom Gilt	2,75 %	07.09.2024	1.710.922	7,90
997.000	United Kingdom Gilt	0,25 %	31.01.2025	953.471	4,40
1.399.000	United Kingdom Gilt	5,00 %	07.03.2025	1.510.011	6,98
2.066.000	United Kingdom Gilt	0,63 %	07.06.2025	1.993.298	9,21
1.898.000	United Kingdom Gilt 'REGS'	2,00 %	07.09.2025	1.902.479	8,79
1.694.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	30.01.2026	1.592.157	7,35
2.077.000	United Kingdom Gilt	1,50 %	22.07.2026	2.044.391	9,44
1.577.000	United Kingdom Gilt	0,38 %	22.10.2026	1.473.959	6,81
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>				<b>21.554.315</b>	<b>99,56</b>
<b>Staatsanleihe insgesamt</b>				<b>21.554.315</b>	<b>99,56</b>
<b>Gesamtanlagen</b>					
Staatsanleihe				21.554.315	99,56
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten*				95.031	0,44
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>21.649.346</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					98,98
Sonstige Vermögenswerte					1,02
					<b>100,00</b>
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 4.794.480 £ enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %)</b>					
<b>Australien (30. Juni 2021: 2,03 %)</b>					
225.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' FRN		25.11.2035	179.768	0,20
50.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	2,85 %	18.05.2026	47.967	0,05
80.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	2,55 %	14.03.2027	74.770	0,08
80.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	3,90 %	16.03.2028	78.732	0,09
225.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	3,31 %	11.03.2041	171.159	0,19
25.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'	3,90 %	12.07.2047	22.392	0,02
165.000	Macquarie Bank Ltd '144A'	2,30 %	22.01.2025	158.444	0,17
200.000	Macquarie Bank Ltd '144A' FRN		03.03.2036	160.903	0,18
100.000	Macquarie Group Ltd '144A' FRN		15.01.2030	99.933	0,11
250.000	National Australia Bank Ltd/New York	2,88 %	12.04.2023	250.221	0,27
250.000	Santos Finance Ltd 'EMTN'	5,25 %	13.03.2029	241.971	0,26
60.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A'	3,75 %	23.03.2027	57.820	0,06
157.000	Suncorp-Metway Ltd '144A'	3,30 %	15.04.2024	155.635	0,17
50.000	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd '144A'	3,90 %	22.03.2023	49.998	0,06
50.000	Transurban Finance Co Pty Ltd '144A'	3,38 %	22.03.2027	47.603	0,05
100.000	Westpac Banking Corp	3,30 %	26.02.2024	99.725	0,11
100.000	Westpac Banking Corp	1,15 %	03.06.2026	89.728	0,10
30.000	Westpac Banking Corp	2,65 %	16.01.2030	26.735	0,03
100.000	Westpac Banking Corp	2,96 %	16.11.2040	72.883	0,08
154.000	Westpac Banking Corp 'GMTN' FRN		23.11.2031	148.223	0,16
100.000	Woodside Finance Ltd '144A'	3,65 %	05.03.2025	98.364	0,11
<b>Australien insgesamt</b>				<b>2.332.974</b>	<b>2,55</b>
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 0,05 %)</b>					
100.000	Triton Container International Ltd '144A'	3,15 %	15.06.2031	80.962	0,09
<b>Bermuda insgesamt</b>				<b>80.962</b>	<b>0,09</b>

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Kanada (30. Juni 2021: 3,54 %)</b>					
100.000	Alimentation Couche-Tard Inc '144A'	2,95 %	25.01.2030	86.541	0,09
100.000	Bank of Montreal	3,30 %	05.02.2024	99.935	0,11
70.000	Bank of Montreal FRN		05.10.2028	70.013	0,08
130.000	Bank of Montreal FRN		10.01.2037	106.569	0,12
100.000	Bank of Montreal 'MTN'	1,85 %	01.05.2025	94.761	0,10
100.000	Bank of Nova Scotia/The	3,40 %	11.02.2024	99.739	0,11
100.000	Bank of Nova Scotia/The	0,70 %	15.04.2024	94.873	0,10
100.000	Bank of Nova Scotia/The	2,70 %	03.08.2026	94.140	0,10
50.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The	4,30 %	29.07.2049	45.165	0,05
137.000	Brookfield Finance Inc	4,35 %	15.04.2030	131.179	0,14
50.000	Brookfield Finance Inc	4,70 %	20.09.2047	43.542	0,05
100.000	Canadian Imperial Bank of Commerce	0,95 %	23.06.2023	97.172	0,11
100.000	Canadian Imperial Bank of Commerce	0,50 %	14.12.2023	95.894	0,10
125.000	Canadian Imperial Bank of Commerce	2,25 %	28.01.2025	119.976	0,13
40.000	Canadian Imperial Bank of Commerce FRN		22.07.2023	39.977	0,04
100.000	Canadian National Railway Co	2,75 %	01.03.2026	96.287	0,10
75.000	Canadian National Railway Co	2,45 %	01.05.2050	50.837	0,06
100.000	Canadian Pacific Railway Co	2,90 %	01.02.2025	97.065	0,11
100.000	Canadian Pacific Railway Co	2,05 %	05.03.2030	84.694	0,09
50.000	Enbridge Inc	2,50 %	15.01.2025	48.191	0,05
40.000	Enbridge Inc	3,13 %	15.11.2029	36.374	0,04
50.000	Enbridge Inc	5,50 %	01.12.2046	51.712	0,06
100.000	Manulife Financial Corp	2,48 %	19.05.2027	91.351	0,10
150.000	Manulife Financial Corp	5,38 %	04.03.2046	160.922	0,18
200.000	Nutrien Ltd	2,95 %	13.05.2030	179.193	0,20
111.000	Rogers Communications Inc	3,00 %	15.03.2023	110.592	0,12
175.000	Rogers Communications Inc	4,35 %	01.05.2049	148.299	0,16
100.000	Rogers Communications Inc '144A'	4,50 %	15.03.2042	89.283	0,10

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Kanada (30. Juni 2021: 3,54 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Royal Bank of Canada	1,20 %	27.04.2026	89.738	0,10
100.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	2,55 %	16.07.2024	97.827	0,11
50.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	2,25 %	01.11.2024	48.352	0,05
75.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	4,65 %	27.01.2026	75.817	0,08
50.000	Royal Bank of Canada 'GMTN'	2,30 %	03.11.2031	41.755	0,05
50.000	TELUS Corp	3,40 %	13.05.2032	44.913	0,05
100.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'	0,75 %	12.06.2023	97.113	0,11
100.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'	2,65 %	12.06.2024	98.284	0,11
100.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'	1,15 %	12.06.2025	92.390	0,10
75.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'	0,75 %	11.09.2025	67.800	0,07
100.000	TransCanada PipeLines Ltd	2,50 %	01.08.2022	99.965	0,11
69.000	TransCanada PipeLines Ltd	4,10 %	15.04.2030	66.060	0,07
50.000	TransCanada PipeLines Ltd	5,00 %	16.10.2043	48.193	0,05
<b>Kanada insgesamt</b>				<b>3.532.483</b>	<b>3,86</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 0,47 %)</b>					
50.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A'	4,25 %	15.04.2026	46.371	0,05
100.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A'	3,25 %	15.02.2027	88.607	0,10
79.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A'	2,53 %	18.11.2027	64.385	0,07
28.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A'	5,50 %	15.02.2024	27.799	0,03
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>				<b>227.162</b>	<b>0,25</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: – %)</b>					
500.000	Danske Bank A/S '144A'	1,23 %	22.06.2024	470.193	0,51
<b>Dänemark insgesamt</b>				<b>470.193</b>	<b>0,51</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 2,01 %)</b>					
200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A'	3,75 %	20.07.2023	200.244	0,22

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 2,01 %) (Fortsetzung)</b>					
200.000	BNP Paribas SA '144A'	4,63 %	13.03.2027	196.352	0,22
200.000	BNP Paribas SA '144A'	4,40 %	14.08.2028	191.979	0,21
200.000	BNP Paribas SA '144A' FRN		10.01.2025	200.227	0,22
100.000	BNP Paribas SA 'MTN'	3,25 %	03.03.2023	100.138	0,11
200.000	BPCE SA '144A'	5,15 %	21.07.2024	200.615	0,22
250.000	BPCE SA '144A'	1,00 %	20.01.2026	222.236	0,24
200.000	Credit Agricole SA '144A'	4,38 %	17.03.2025	196.771	0,22
75.000	Electricite de France SA '144A'	3,63 %	13.10.2025	73.526	0,08
230.000	La Mondiale SAM FRN		26.01.2047	223.675	0,24
70.000	Orange SA	9,00 %	01.03.2031	90.538	0,10
150.000	Pernod Ricard SA '144A'	3,25 %	08.06.2026	145.612	0,16
50.000	Sanofi	3,63 %	19.06.2028	49.518	0,05
200.000	Societe Generale SA '144A'	4,25 %	14.09.2023	200.316	0,22
200.000	Societe Generale SA '144A'	4,25 %	19.08.2026	192.615	0,21
200.000	Societe Generale SA '144A'	4,75 %	14.09.2028	193.161	0,21
<b>Frankreich insgesamt</b>				<b>2.677.523</b>	<b>2,93</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 0,19 %)</b>					
75.000	Deutsche Bank AG/London	3,70 %	30.05.2024	74.308	0,08
150.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN		07.01.2028	130.061	0,14
<b>Deutschland insgesamt</b>				<b>204.369</b>	<b>0,22</b>
<b>International (30. Juni 2021: 0,51 %)</b>					
99.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd	3,88 %	15.01.2027	95.608	0,11
100.000	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A'	4,75 %	20.10.2028	94.500	0,10
100.000	NXP BV / NXP Funding LLC	5,35 %	01.03.2026	101.969	0,11
121.000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc	4,30 %	18.06.2029	115.706	0,13
<b>International insgesamt</b>				<b>407.783</b>	<b>0,45</b>

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Irland (30. Juni 2021: 0,66 %)</b>					
150.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	4,88 %	16.01.2024	149.904	0,16
150.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	2,88 %	14.08.2024	143.414	0,16
200.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	3,30 %	30.01.2032	160.254	0,18
100.000	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA	1,75 %	15.09.2030	81.359	0,09
16.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	2,88 %	23.09.2023	15.806	0,02
200.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 'EMTN' FRN		19.04.2051	158.875	0,17
<b>Irland insgesamt</b>				<b>709.612</b>	<b>0,78</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 2,65 %)</b>					
200.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	3,46 %	02.03.2023	200.356	0,22
200.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	2,80 %	18.07.2024	195.048	0,21
171.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	4,29 %	26.07.2038	159.539	0,17
50.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	4,15 %	07.03.2039	45.813	0,05
173.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN		26.07.2023	173.264	0,19
200.000	Mizuho Financial Group Inc '144A'	3,48 %	12.04.2026	192.650	0,21
200.000	Mizuho Financial Group Inc FRN		25.05.2026	187.214	0,21
200.000	Nippon Life Insurance Co '144A' FRN		20.01.2046	196.000	0,21
200.000	Nomura Holdings Inc	2,17 %	14.07.2028	168.842	0,18
200.000	NTT Finance Corp '144A'	1,16 %	03.04.2026	180.477	0,20
75.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3,94 %	16.10.2023	75.374	0,08
100.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3,78 %	09.03.2026	98.202	0,11
157.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3,45 %	11.01.2027	151.104	0,17
157.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3,20 %	17.09.2029	139.521	0,15
75.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	2,14 %	23.09.2030	60.279	0,07
300.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd '144A'	2,55 %	10.03.2025	288.040	0,32
225.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	3,03 %	09.07.2040	174.823	0,19
<b>Japan insgesamt</b>				<b>2.686.546</b>	<b>2,94</b>

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 0,19 %)</b>					
100.000	DH Europe Finance II Sarl	2,05 %	15.11.2022	99.737	0,11
50.000	DH Europe Finance II Sarl	3,25 %	15.11.2039	41.727	0,05
50.000	Schlumberger Investment SA	3,65 %	01.12.2023	50.158	0,05
72.000	Schlumberger Investment SA	2,65 %	26.06.2030	63.203	0,07
<b>Luxemburg insgesamt</b>				<b>254.825</b>	<b>0,28</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 2,34 %)</b>					
250.000	Cooperatieve Rabobank UA '144A'	2,63 %	22.07.2024	242.487	0,27
51.000	Cooperatieve Rabobank UA 'BKNT'	5,25 %	24.05.2041	55.268	0,06
115.000	Deutsche Telekom International Finance BV	8,75 %	15.06.2030	142.174	0,16
150.000	Deutsche Telekom International Finance BV '144A'	3,60 %	19.01.2027	146.672	0,16
136.000	Heineken NV '144A'	3,50 %	29.01.2028	131.478	0,14
200.000	ING Groep NV	3,95 %	29.03.2027	193.007	0,21
50.000	Koninklijke Philips NV	5,00 %	15.03.2042	48.385	0,05
50.000	LYB International Finance BV	5,25 %	15.07.2043	46.969	0,05
50.000	LyondellBasell Industries NV	4,63 %	26.02.2055	43.333	0,05
200.000	Prosus NV '144A'	3,06 %	13.07.2031	148.100	0,16
250.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A'	3,40 %	16.03.2027	242.211	0,27
<b>Niederlande insgesamt</b>				<b>1.440.084</b>	<b>1,58</b>
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 0,29 %)</b>					
60.000	Equinor ASA	3,70 %	01.03.2024	60.229	0,06
81.000	Equinor ASA	3,63 %	10.09.2028	78.914	0,09
158.000	Equinor ASA	3,70 %	06.04.2050	136.609	0,15
100.000	Yara International ASA '144A'	3,15 %	04.06.2030	85.119	0,09
<b>Norwegen insgesamt</b>				<b>360.871</b>	<b>0,39</b>

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Spanien (30. Juni 2021: 0,67 %)</b>					
200.000	Banco Santander SA	2,75 %	28.05.2025	189.706	0,21
200.000	Banco Santander SA	4,25 %	11.04.2027	192.911	0,21
200.000	Banco Santander SA FRN		30.06.2024	192.977	0,21
150.000	Telefonica Emisiones SA	5,21 %	08.03.2047	132.648	0,14
<b>Spanien insgesamt</b>				<b>708.242</b>	<b>0,77</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 1,63 %)</b>					
250.000	Credit Suisse AG/New York NY	1,00 %	05.05.2023	244.986	0,27
250.000	Credit Suisse Group AG	3,75 %	26.03.2025	242.597	0,26
200.000	UBS AG/London '144A'	0,70 %	09.08.2024	187.733	0,20
200.000	UBS Group AG '144A'	4,13 %	15.04.2026	197.209	0,22
225.000	UBS Group AG '144A' FRN		11.02.2032	179.204	0,20
<b>Schweiz insgesamt</b>				<b>1.051.729</b>	<b>1,15</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 5,40 %)</b>					
100.000	AstraZeneca Plc	3,38 %	16.11.2025	98.781	0,11
100.000	AstraZeneca Plc	0,70 %	08.04.2026	89.135	0,10
100.000	AstraZeneca Plc	2,13 %	06.08.2050	67.557	0,07
200.000	Barclays Bank Plc 'BKNT'	3,75 %	15.05.2024	198.611	0,22
200.000	Barclays Plc	4,34 %	10.01.2028	191.620	0,21
200.000	Barclays Plc FRN		10.03.2032	161.960	0,18
200.000	Diageo Capital Plc	2,38 %	24.10.2029	177.657	0,19
100.000	HSBC Holdings Plc	6,50 %	02.05.2036	106.577	0,12
150.000	HSBC Holdings Plc	6,80 %	01.06.2038	162.591	0,18
75.000	HSBC Holdings Plc	6,10 %	14.01.2042	84.069	0,09
200.000	HSBC Holdings Plc FRN		22.11.2023	199.210	0,22
200.000	HSBC Holdings Plc FRN		18.04.2026	183.678	0,20

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 5,40 %) (Fortsetzung)</b>					
200.000	HSBC Holdings Plc FRN		19.06.2029	193.100	0,21
200.000	Lloyds Banking Group Plc	4,05 %	16.08.2023	200.743	0,22
200.000	Lloyds Banking Group Plc	4,45 %	08.05.2025	200.337	0,22
200.000	Lloyds Banking Group Plc FRN		07.11.2028	187.724	0,20
200.000	Nationwide Building Society '144A' FRN		01.08.2024	200.172	0,22
100.000	NatWest Group Plc	5,13 %	28.05.2024	100.634	0,11
200.000	NatWest Group Plc	4,80 %	05.04.2026	199.359	0,22
100.000	Royalty Pharma Plc	0,75 %	02.09.2023	96.381	0,11
50.000	Royalty Pharma Plc	1,75 %	02.09.2027	42.722	0,05
200.000	Santander UK Group Holdings Plc FRN		15.11.2024	200.701	0,22
200.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN		15.03.2024	199.617	0,22
200.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN		21.05.2025	196.543	0,21
200.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN		12.01.2033	165.678	0,18
50.000	Vodafone Group Plc	3,75 %	16.01.2024	50.339	0,05
40.000	Vodafone Group Plc	7,88 %	15.02.2030	47.425	0,05
70.000	Vodafone Group Plc	5,25 %	30.05.2048	67.145	0,07
125.000	Vodafone Group Plc	4,88 %	19.06.2049	115.279	0,13
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>				<b>4.185.345</b>	<b>4,58</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %)</b>					
50.000	3M Co	2,00 %	14.02.2025	48.141	0,05
100.000	3M Co	2,88 %	15.10.2027	96.145	0,11
50.000	3M Co	3,25 %	26.08.2049	40.056	0,04
75.000	7-Eleven Inc '144A'	0,80 %	10.02.2024	71.275	0,08
50.000	Abbott Laboratories	3,75 %	30.11.2026	50.363	0,06
40.000	Abbott Laboratories	4,75 %	30.11.2036	42.346	0,05
25.000	Abbott Laboratories	5,30 %	27.05.2040	27.333	0,03
53.000	Abbott Laboratories	4,90 %	30.11.2046	55.789	0,06

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
50.000	AbbVie Inc	2,90 %	06.11.2022	50.009	0,05
25.000	AbbVie Inc	3,75 %	14.11.2023	25.158	0,03
60.000	AbbVie Inc	3,85 %	15.06.2024	60.009	0,07
100.000	AbbVie Inc	2,60 %	21.11.2024	96.998	0,11
50.000	AbbVie Inc	3,60 %	14.05.2025	49.388	0,05
40.000	AbbVie Inc	3,20 %	14.05.2026	38.535	0,04
100.000	AbbVie Inc	2,95 %	21.11.2026	94.876	0,10
40.000	AbbVie Inc	4,30 %	14.05.2036	37.799	0,04
50.000	AbbVie Inc	4,05 %	21.11.2039	44.928	0,05
100.000	AbbVie Inc	4,40 %	06.11.2042	91.022	0,10
45.000	AbbVie Inc	4,45 %	14.05.2046	41.369	0,05
65.000	AbbVie Inc	4,25 %	21.11.2049	57.756	0,06
50.000	Aetna Inc	6,63 %	15.06.2036	56.970	0,06
50.000	Aetna Inc	4,13 %	15.11.2042	43.223	0,05
75.000	Aflac Inc	4,75 %	15.01.2049	72.193	0,08
200.000	Air Lease Corp	3,63 %	01.12.2027	178.985	0,20
50.000	Air Lease Corp 'MTN'	4,25 %	01.02.2024	49.581	0,05
50.000	Air Lease Corp 'MTN'	2,88 %	15.01.2026	46.062	0,05
40.000	Air Products and Chemicals Inc	1,85 %	15.05.2027	36.393	0,04
30.000	Air Products and Chemicals Inc	2,80 %	15.05.2050	22.876	0,03
151.000	Alexandria Real Estate Equities Inc	4,90 %	15.12.2030	150.431	0,16
100.000	Alexandria Real Estate Equities Inc	3,38 %	15.08.2031	88.866	0,10
25.000	Alexandria Real Estate Equities Inc	2,00 %	18.05.2032	19.813	0,02
40.000	Allstate Corp/The	5,55 %	09.05.2035	43.465	0,05
50.000	Allstate Corp/The	4,20 %	15.12.2046	45.296	0,05
100.000	Ally Financial Inc	8,00 %	01.11.2031	111.330	0,12
50.000	Alphabet Inc	2,00 %	15.08.2026	47.413	0,05
50.000	Alphabet Inc	2,05 %	15.08.2050	33.817	0,04

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
50.000	Amcor Finance USA Inc	3,63 %	28.04.2026	48.015	0,05
112.000	American Equity Investment Life Holding Co	5,00 %	15.06.2027	110.720	0,12
100.000	American Express Co	3,70 %	03.08.2023	100.429	0,11
100.000	American Express Credit Corp 'MTN'	3,30 %	03.05.2027	96.225	0,11
156.000	American Honda Finance Corp 'MTN'	2,90 %	16.02.2024	154.593	0,17
40.000	American Honda Finance Corp 'MTN'	1,80 %	13.01.2031	32.862	0,04
100.000	American International Group Inc	3,40 %	30.06.2030	91.575	0,10
61.000	American International Group Inc	4,50 %	16.07.2044	54.596	0,06
125.000	American International Group Inc	4,75 %	01.04.2048	118.547	0,13
125.000	American Tower Corp	2,95 %	15.01.2025	120.870	0,13
100.000	American Tower Corp	1,50 %	31.01.2028	83.310	0,09
40.000	American Tower Corp	2,70 %	15.04.2031	33.018	0,04
167.000	American Water Capital Corp	3,75 %	01.09.2047	139.878	0,15
50.000	AmerisourceBergen Corp	2,80 %	15.05.2030	43.926	0,05
40.000	Amgen Inc	3,63 %	22.05.2024	39.957	0,04
50.000	Amgen Inc	3,13 %	01.05.2025	49.091	0,05
40.000	Amgen Inc	2,20 %	21.02.2027	36.725	0,04
50.000	Amgen Inc	1,65 %	15.08.2028	42.935	0,05
40.000	Amgen Inc	2,30 %	25.02.2031	34.057	0,04
100.000	Amgen Inc	3,15 %	21.02.2040	79.151	0,09
100.000	Amgen Inc	4,95 %	01.10.2041	97.174	0,11
50.000	Amgen Inc	3,38 %	21.02.2050	38.508	0,04
25.000	Amgen Inc	2,77 %	01.09.2053	16.957	0,02
25.000	Amgen Inc	4,40 %	22.02.2062	21.886	0,02
75.000	Analog Devices Inc	3,50 %	05.12.2026	73.959	0,08
100.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	3,65 %	01.02.2026	98.564	0,11
175.000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	4,90 %	01.02.2046	165.064	0,18
65.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc	4,00 %	17.01.2043	54.249	0,06

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
125.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	3,50 %	01.06.2030	117.531	0,13
150.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	5,45 %	23.01.2039	152.667	0,17
80.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	4,60 %	15.04.2048	72.066	0,08
50.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	5,55 %	23.01.2049	51.576	0,06
60.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	5,80 %	23.01.2059	62.627	0,07
40.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc	4,60 %	01.06.2060	35.258	0,04
200.000	Elevance Health Inc	2,88 %	15.09.2029	180.539	0,20
100.000	Elevance Health Inc	4,38 %	01.12.2047	92.274	0,10
40.000	Elevance Health Inc	3,70 %	15.09.2049	33.158	0,04
125.000	Elevance Health Inc	3,13 %	15.05.2050	95.038	0,10
50.000	Aon Corp	3,75 %	02.05.2029	47.342	0,05
100.000	Apollo Management Holdings LP '144A'	4,00 %	30.05.2024	98.633	0,11
100.000	Apollo Management Holdings LP '144A'	4,40 %	27.05.2026	98.887	0,11
50.000	Apple Inc	2,40 %	03.05.2023	49.740	0,05
100.000	Apple Inc	3,45 %	06.05.2024	100.684	0,11
100.000	Apple Inc	2,75 %	13.01.2025	98.958	0,11
100.000	Apple Inc	1,13 %	11.05.2025	94.018	0,10
100.000	Apple Inc	2,05 %	11.09.2026	94.298	0,10
100.000	Apple Inc	3,20 %	11.05.2027	98.543	0,11
25.000	Apple Inc	1,20 %	08.02.2028	21.977	0,02
100.000	Apple Inc	2,20 %	11.09.2029	90.264	0,10
100.000	Apple Inc	3,45 %	09.02.2045	87.487	0,10
117.000	Apple Inc	3,75 %	12.09.2047	106.193	0,12
40.000	Apple Inc	2,65 %	08.02.2051	29.695	0,03
75.000	Apple Inc	2,55 %	20.08.2060	51.983	0,06
170.000	Applied Materials Inc	5,10 %	01.10.2035	179.055	0,20
100.000	Archer-Daniels-Midland Co	3,25 %	27.03.2030	94.382	0,10
160.000	Ares Capital Corp	3,50 %	10.02.2023	159.373	0,17

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
35.000	Ares Capital Corp	2,88 %	15.06.2028	27.672	0,03
63.000	Arrow Electronics Inc	3,88 %	12.01.2028	60.335	0,07
100.000	AT&T Inc	4,25 %	01.03.2027	99.933	0,11
100.000	AT&T Inc	2,30 %	01.06.2027	91.458	0,10
100.000	AT&T Inc	1,65 %	01.02.2028	86.609	0,09
100.000	AT&T Inc	4,30 %	15.02.2030	97.709	0,11
75.000	AT&T Inc	2,75 %	01.06.2031	64.777	0,07
100.000	AT&T Inc	2,55 %	01.12.2033	81.544	0,09
50.000	AT&T Inc	4,85 %	01.03.2039	48.121	0,05
51.000	AT&T Inc	3,50 %	01.06.2041	40.903	0,04
76.000	AT&T Inc	4,30 %	15.12.2042	66.675	0,07
225.000	AT&T Inc	3,10 %	01.02.2043	168.330	0,18
150.000	AT&T Inc	3,50 %	15.09.2053	114.644	0,13
250.000	AT&T Inc	3,85 %	01.06.2060	194.335	0,21
200.000	Athene Global Funding '144A'	1,00 %	16.04.2024	188.301	0,21
100.000	Autodesk Inc	3,50 %	15.06.2027	95.933	0,11
100.000	AutoZone Inc	1,65 %	15.01.2031	78.707	0,09
100.000	AvalonBay Communities Inc 'MTN'	2,45 %	15.01.2031	86.600	0,09
100.000	Avangrid Inc	3,15 %	01.12.2024	97.805	0,11
100.000	Aviation Capital Group LLC '144A'	1,95 %	30.01.2026	87.353	0,10
110.000	Aviation Capital Group LLC '144A'	1,95 %	20.09.2026	93.889	0,10
96.000	Avnet Inc	4,63 %	15.04.2026	96.495	0,11
40.000	Baker Hughes Holdings LLC	5,13 %	15.09.2040	39.442	0,04
50.000	Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc	3,34 %	15.12.2027	47.371	0,05
97.000	Bank of America Corp	4,18 %	25.11.2027	94.211	0,10
200.000	Bank of America Corp FRN		20.12.2023	199.473	0,22
40.000	Bank of America Corp FRN		22.04.2025	39.038	0,04
160.000	Bank of America Corp FRN		23.01.2026	155.201	0,17

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Bank of America Corp FRN		20.12.2028	93.446	0,10
250.000	Bank of America Corp FRN		11.03.2032	210.563	0,23
140.000	Bank of America Corp FRN		22.04.2032	118.079	0,13
60.000	Bank of America Corp FRN		04.02.2033	51.197	0,06
50.000	Bank of America Corp FRN		08.03.2037	43.252	0,05
75.000	Bank of America Corp FRN		22.04.2042	59.139	0,06
50.000	Bank of America Corp FRN		21.07.2052	35.516	0,04
225.000	Bank of America Corp 'GMTN' FRN		23.07.2024	223.568	0,24
100.000	Bank of America Corp 'MTN'	4,00 %	22.01.2025	99.545	0,11
100.000	Bank of America Corp 'MTN'	4,25 %	22.10.2026	98.738	0,11
100.000	Bank of America Corp 'MTN'	3,25 %	21.10.2027	94.675	0,10
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		23.07.2024	99.463	0,11
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		25.09.2025	92.783	0,10
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		22.10.2025	95.420	0,10
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		19.06.2026	91.007	0,10
65.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		24.10.2026	58.298	0,06
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		14.06.2029	85.878	0,09
157.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		07.02.2030	148.005	0,16
100.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		13.02.2031	84.566	0,09
140.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		23.04.2040	124.875	0,14
40.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		19.06.2041	28.814	0,03
48.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		20.01.2048	44.358	0,05
135.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN		20.03.2051	116.164	0,13
75.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	2,20 %	16.08.2023	74.319	0,08
50.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	3,25 %	11.09.2024	49.655	0,05
100.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	1,60 %	24.04.2025	94.162	0,10
154.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	3,25 %	16.05.2027	149.136	0,16
100.000	Bank of New York Mellon Corp/The 'MTN'	3,30 %	23.08.2029	92.141	0,10

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Barrick North America Finance LLC	5,70 %	30.05.2041	104.404	0,11
50.000	Baxter International Inc	2,60 %	15.08.2026	46.728	0,05
100.000	Baxter International Inc	3,95 %	01.04.2030	95.955	0,11
50.000	Baxter International Inc	2,54 %	01.02.2032	42.330	0,05
50.000	Bayer US Finance II LLC '144A'	3,38 %	15.07.2024	49.170	0,05
50.000	Bayer US Finance II LLC '144A'	4,40 %	15.07.2044	41.965	0,05
25.000	Bayer US Finance II LLC '144A'	4,70 %	15.07.2064	20.923	0,02
50.000	Baylor Scott & White Holdings	2,84 %	15.11.2050	36.556	0,04
75.000	Becton Dickinson and Co	3,70 %	06.06.2027	72.877	0,08
50.000	Becton Dickinson and Co	4,67 %	06.06.2047	46.898	0,05
75.000	Berry Global Inc	1,57 %	15.01.2026	67.328	0,07
100.000	Best Buy Co Inc	4,45 %	01.10.2028	98.522	0,11
25.000	Biogen Inc	3,15 %	01.05.2050	17.382	0,02
67.000	Biogen Inc	3,25 %	15.02.2051	44.742	0,05
140.000	BlackRock Inc	1,90 %	28.01.2031	116.776	0,13
50.000	Blackstone Holdings Finance Co LLC '144A'	5,00 %	15.06.2044	49.226	0,05
25.000	Blackstone Holdings Finance Co LLC '144A'	3,20 %	30.01.2052	18.326	0,02
75.000	Blackstone Private Credit Fund '144A'	2,63 %	15.12.2026	62.793	0,07
100.000	Blackstone Private Credit Fund '144A'	4,00 %	15.01.2029	82.012	0,09
100.000	BMW US Capital LLC '144A'	3,80 %	06.04.2023	100.392	0,11
100.000	BMW US Capital LLC '144A'	4,15 %	09.04.2030	98.488	0,11
50.000	BorgWarner Inc	2,65 %	01.07.2027	45.489	0,05
100.000	Boston Properties LP	3,65 %	01.02.2026	97.206	0,11
66.000	Boston Properties LP	3,25 %	30.01.2031	57.066	0,06
50.000	Boston Scientific Corp	2,65 %	01.06.2030	43.497	0,05
50.000	Bristol-Myers Squibb Co	2,75 %	15.02.2023	49.725	0,05
75.000	Bristol-Myers Squibb Co	2,90 %	26.07.2024	74.342	0,08
50.000	Bristol-Myers Squibb Co	3,20 %	15.06.2026	49.317	0,05

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
75.000	Bristol-Myers Squibb Co	3,90 %	20.02.2028	75.348	0,08
30.000	Bristol-Myers Squibb Co	4,13 %	15.06.2039	28.817	0,03
100.000	Bristol-Myers Squibb Co	4,25 %	26.10.2049	94.178	0,10
100.000	Bristol-Myers Squibb Co	2,55 %	13.11.2050	71.099	0,08
50.000	Brixmor Operating Partnership LP	4,13 %	15.06.2026	49.002	0,05
75.000	Broadcom Inc	3,46 %	15.09.2026	71.992	0,08
26.000	Broadcom Inc	4,15 %	15.11.2030	23.827	0,03
140.000	Broadcom Inc	4,30 %	15.11.2032	127.569	0,14
50.000	Broadcom Inc '144A'	2,45 %	15.02.2031	40.270	0,04
130.000	Broadcom Inc '144A'	2,60 %	15.02.2033	100.086	0,11
126.000	Broadcom Inc '144A'	3,47 %	15.04.2034	102.972	0,11
333.000	Broadcom Inc '144A'	4,93 %	15.05.2037	299.449	0,33
75.000	Broadcom Inc '144A'	3,75 %	15.02.2051	55.604	0,06
100.000	Brookfield Finance LLC	3,45 %	15.04.2050	71.742	0,08
100.000	Brooklyn Union Gas Co/The '144A'	4,50 %	10.03.2046	86.389	0,09
100.000	Brown & Brown Inc	4,95 %	17.03.2052	88.630	0,10
25.000	Bunge Ltd Finance Corp	3,75 %	25.09.2027	24.039	0,03
101.000	Burlington Northern Santa Fe LLC	4,15 %	01.04.2045	92.622	0,10
100.000	Burlington Northern Santa Fe LLC	3,90 %	01.08.2046	89.500	0,10
75.000	Burlington Northern Santa Fe LLC	3,05 %	15.02.2051	57.424	0,06
100.000	California Institute of Technology	3,65 %	01.09.2119	74.542	0,08
150.000	Cameron LNG LLC '144A'	3,70 %	15.01.2039	126.619	0,14
25.000	Campbell Soup Co	4,15 %	15.03.2028	24.508	0,03
57.000	Campbell Soup Co	4,80 %	15.03.2048	53.683	0,06
100.000	Capital One Financial Corp	3,90 %	29.01.2024	99.947	0,11
25.000	Capital One Financial Corp	4,20 %	29.10.2025	24.775	0,03
175.000	Capital One Financial Corp	3,80 %	31.01.2028	164.948	0,18
100.000	Capital One Financial Corp FRN		29.07.2032	76.622	0,08

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
43.000	Cardinal Health Inc	3,41 %	15.06.2027	41.433	0,05
100.000	Caterpillar Financial Services Corp 'MTN'	0,45 %	14.09.2023	97.144	0,11
100.000	Caterpillar Financial Services Corp 'MTN'	2,15 %	08.11.2024	97.088	0,11
50.000	Caterpillar Financial Services Corp 'MTN'	0,80 %	13.11.2025	45.611	0,05
100.000	Caterpillar Inc	2,60 %	09.04.2030	91.234	0,10
51.000	Caterpillar Inc	3,80 %	15.08.2042	46.642	0,05
50.000	Caterpillar Inc	3,25 %	19.09.2049	42.389	0,05
50.000	CF Industries Inc	4,95 %	01.06.2043	44.762	0,05
50.000	CF Industries Inc '144A'	4,50 %	01.12.2026	49.565	0,05
30.000	Charles Schwab Corp/The	0,75 %	18.03.2024	28.816	0,03
100.000	Charles Schwab Corp/The	0,90 %	11.03.2026	90.213	0,10
100.000	Charles Schwab Corp/The	3,30 %	01.04.2027	96.530	0,11
75.000	Charles Schwab Corp/The	1,65 %	11.03.2031	60.065	0,07
25.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4,91 %	23.07.2025	25.183	0,03
200.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4,20 %	15.03.2028	188.282	0,21
70.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3,50 %	01.06.2041	49.689	0,05
92.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	6,48 %	23.10.2045	90.364	0,10
80.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4,80 %	01.03.2050	63.781	0,07
50.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3,90 %	01.06.2052	35.063	0,04
125.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	7,00 %	30.06.2024	129.673	0,14
50.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	5,13 %	30.06.2027	50.272	0,06
100.000	Chevron Phillips Chemical Co LLC / Chevron Phillips Chemical Co LP '144A'	3,40 %	01.12.2026	97.735	0,11
30.000	Chubb Corp/The	6,50 %	15.05.2038	35.348	0,04
50.000	Chubb INA Holdings Inc	3,35 %	15.05.2024	49.919	0,05
125.000	Chubb INA Holdings Inc	4,35 %	03.11.2045	117.617	0,13
50.000	Cigna Corp	3,00 %	15.07.2023	49.731	0,05
100.000	Cigna Corp	3,25 %	15.04.2025	98.190	0,11

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
50.000	Cigna Corp	3,40 %	01.03.2027	48.129	0,05
75.000	Cigna Corp	4,38 %	15.10.2028	74.329	0,08
50.000	Cigna Corp	4,80 %	15.08.2038	48.633	0,05
150.000	Cigna Corp	4,90 %	15.12.2048	145.435	0,16
50.000	Cisco Systems Inc	2,60 %	28.02.2023	49.937	0,05
25.000	Cisco Systems Inc	3,63 %	04.03.2024	25.181	0,03
77.000	Cisco Systems Inc	5,90 %	15.02.2039	87.763	0,10
100.000	Citadel LP '144A'	4,88 %	15.01.2027	96.727	0,11
100.000	Citigroup Inc	3,75 %	16.06.2024	100.445	0,11
100.000	Citigroup Inc	4,40 %	10.06.2025	99.858	0,11
125.000	Citigroup Inc	4,13 %	25.07.2028	120.192	0,13
30.000	Citigroup Inc	6,63 %	15.06.2032	32.975	0,04
66.000	Citigroup Inc	8,13 %	15.07.2039	87.132	0,10
25.000	Citigroup Inc	6,68 %	13.09.2043	28.225	0,03
50.000	Citigroup Inc	4,65 %	30.07.2045	46.146	0,05
66.000	Citigroup Inc	4,75 %	18.05.2046	59.352	0,07
50.000	Citigroup Inc	4,65 %	23.07.2048	46.491	0,05
75.000	Citigroup Inc FRN		24.07.2023	75.014	0,08
22.000	Citigroup Inc FRN		15.05.2024	21.567	0,02
72.000	Citigroup Inc FRN		17.05.2024	71.428	0,08
100.000	Citigroup Inc FRN		01.05.2025	93.877	0,10
130.000	Citigroup Inc FRN		01.07.2026	127.064	0,14
125.000	Citigroup Inc FRN		10.01.2028	120.246	0,13
50.000	Citigroup Inc FRN		27.10.2028	46.731	0,05
200.000	Citigroup Inc FRN		20.03.2030	187.526	0,21
100.000	Citigroup Inc FRN		31.03.2031	95.572	0,10
200.000	Citigroup Inc FRN		01.05.2032	165.050	0,18
75.000	Citigroup Inc FRN		17.03.2033	67.681	0,07

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Citrix Systems Inc	3,30 %	01.03.2030	98.000	0,11
30.000	CME Group Inc	5,30 %	15.09.2043	32.554	0,04
100.000	CNA Financial Corp	3,45 %	15.08.2027	95.178	0,10
50.000	CNH Industrial Capital LLC	1,45 %	15.07.2026	44.278	0,05
100.000	Coca-Cola Co/The	2,50 %	01.06.2040	78.594	0,09
20.000	Coca-Cola Co/The	2,75 %	01.06.2060	14.487	0,02
42.000	Colonial Enterprises Inc '144A'	3,25 %	15.05.2030	38.190	0,04
100.000	Comcast Corp	3,38 %	15.02.2025	99.267	0,11
50.000	Comcast Corp	3,30 %	01.02.2027	48.682	0,05
100.000	Comcast Corp	3,15 %	15.02.2028	95.230	0,10
100.000	Comcast Corp	1,50 %	15.02.2031	80.341	0,09
134.000	Comcast Corp	3,90 %	01.03.2038	121.390	0,13
50.000	Comcast Corp	4,70 %	15.10.2048	48.405	0,05
89.000	Comcast Corp	2,94 %	01.11.2056	62.384	0,07
50.000	Commonwealth Edison Co	2,55 %	15.06.2026	48.032	0,05
150.000	Commonwealth Edison Co	3,75 %	15.08.2047	129.655	0,14
100.000	Conagra Brands Inc	4,30 %	01.05.2024	100.194	0,11
46.000	Conagra Brands Inc	5,40 %	01.11.2048	43.585	0,05
100.000	Connecticut Light and Power Co/The	4,00 %	01.04.2048	90.966	0,10
150.000	Consolidated Edison Co of New York Inc	4,45 %	15.03.2044	137.668	0,15
100.000	Consolidated Edison Co of New York Inc	3,95 %	01.04.2050	87.281	0,10
125.000	Consolidated Edison Co of New York Inc	3,00 %	01.12.2060	87.760	0,10
100.000	Constellation Brands Inc	3,50 %	09.05.2027	96.299	0,11
125.000	Constellation Brands Inc	3,15 %	01.08.2029	112.975	0,12
20.000	Constellation Brands Inc	4,50 %	09.05.2047	17.925	0,02
100.000	Corebridge Financial Inc '144A'	4,40 %	05.04.2052	84.398	0,09
50.000	Corning Inc	5,35 %	15.11.2048	50.969	0,06
100.000	Cox Communications Inc '144A'	3,50 %	15.08.2027	95.037	0,10

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Cox Communications Inc '144A'	4,50 %	30.06.2043	88.849	0,10
200.000	CRH America Finance Inc '144A'	3,95 %	04.04.2028	194.670	0,21
25.000	Crown Castle International Corp	4,00 %	01.03.2027	24.290	0,03
100.000	Crown Castle International Corp	3,65 %	01.09.2027	94.798	0,10
40.000	Crown Castle International Corp	2,25 %	15.01.2031	32.548	0,04
100.000	CSX Corp	4,25 %	15.03.2029	99.760	0,11
150.000	CSX Corp	3,80 %	01.11.2046	128.635	0,14
25.000	CSX Corp	3,95 %	01.05.2050	22.026	0,02
50.000	CVS Health Corp	3,88 %	20.07.2025	49.778	0,05
100.000	CVS Health Corp	3,63 %	01.04.2027	97.471	0,11
100.000	CVS Health Corp	3,25 %	15.08.2029	91.546	0,10
100.000	CVS Health Corp	1,75 %	21.08.2030	80.285	0,09
40.000	CVS Health Corp	4,78 %	25.03.2038	37.959	0,04
100.000	CVS Health Corp	5,05 %	25.03.2048	96.212	0,11
150.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC '144A'	3,25 %	01.08.2024	148.331	0,16
150.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC '144A'	3,45 %	06.01.2027	144.920	0,16
150.000	Daimler Trucks Finance North America LLC '144A'	2,00 %	14.12.2026	135.079	0,15
50.000	Danaher Corp	4,38 %	15.09.2045	47.424	0,05
100.000	Deere & Co	2,75 %	15.04.2025	97.824	0,11
100.000	Dell International LLC / EMC Corp	5,30 %	01.10.2029	98.740	0,11
100.000	Dell International LLC / EMC Corp	6,20 %	15.07.2030	104.355	0,11
25.000	Dell International LLC / EMC Corp	8,10 %	15.07.2036	29.293	0,03
20.000	DENTSPLY SIRONA Inc	3,25 %	01.06.2030	16.941	0,02
75.000	Devon Energy Corp	5,60 %	15.07.2041	75.151	0,08
100.000	Digital Realty Trust LP	3,70 %	15.08.2027	95.348	0,10
50.000	Discover Financial Services	4,10 %	09.02.2027	47.963	0,05
100.000	Discovery Communications LLC	5,20 %	20.09.2047	86.269	0,09
25.000	Discovery Communications LLC	4,65 %	15.05.2050	19.747	0,02

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
25.000	Discovery Communications LLC	4,00 %	15.09.2055	17.518	0,02
50.000	Dollar General Corp	4,13 %	03.04.2050	42.069	0,05
75.000	Dow Chemical Co/The	4,38 %	15.11.2042	66.660	0,07
25.000	Dow Chemical Co/The	3,60 %	15.11.2050	19.217	0,02
130.000	DuPont de Nemours Inc	4,73 %	15.11.2028	130.350	0,14
25.000	DuPont de Nemours Inc	5,42 %	15.11.2048	25.011	0,03
100.000	Eastman Chemical Co	4,50 %	01.12.2028	98.197	0,11
50.000	Eaton Corp	4,15 %	02.11.2042	45.266	0,05
30.000	eBay Inc	3,45 %	01.08.2024	29.755	0,03
75.000	eBay Inc	3,60 %	05.06.2027	72.253	0,08
50.000	Ecolab Inc	4,80 %	24.03.2030	52.021	0,06
100.000	Edison International	3,55 %	15.11.2024	97.657	0,11
100.000	Eli Lilly & Co	2,25 %	15.05.2050	71.451	0,08
165.000	EMD Finance LLC '144A'	3,25 %	19.03.2025	162.917	0,18
100.000	Emerson Electric Co	1,95 %	15.10.2030	84.657	0,09
50.000	Enterprise Products Operating LLC	3,75 %	15.02.2025	49.536	0,05
50.000	Enterprise Products Operating LLC	4,15 %	16.10.2028	48.851	0,05
140.000	Enterprise Products Operating LLC	2,80 %	31.01.2030	122.889	0,13
100.000	Enterprise Products Operating LLC	5,95 %	01.02.2041	104.690	0,11
47.000	Enterprise Products Operating LLC	4,25 %	15.02.2048	40.108	0,04
48.000	Enterprise Products Operating LLC	4,20 %	31.01.2050	40.462	0,04
69.000	Enterprise Products Operating LLC	3,20 %	15.02.2052	49.976	0,05
100.000	Enterprise Products Operating LLC FRN		16.08.2077	80.383	0,09
25.000	EOG Resources Inc	4,15 %	15.01.2026	25.229	0,03
50.000	EOG Resources Inc	4,95 %	15.04.2050	52.008	0,06
200.000	Equinix Inc	2,63 %	18.11.2024	192.320	0,21
75.000	Equitable Holdings Inc	4,35 %	20.04.2028	72.553	0,08
75.000	Equitable Holdings Inc	5,00 %	20.04.2048	69.739	0,08

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
50.000	ERAC USA Finance LLC '144A'	3,85 %	15.11.2024	49.399	0,05
50.000	ERAC USA Finance LLC '144A'	7,00 %	15.10.2037	59.045	0,06
85.000	ERP Operating LP	3,00 %	01.07.2029	77.216	0,08
40.000	Essex Portfolio LP	2,65 %	15.03.2032	33.339	0,04
150.000	Estee Lauder Cos Inc/The	2,38 %	01.12.2029	134.110	0,15
25.000	Estee Lauder Cos Inc/The	3,13 %	01.12.2049	19.877	0,02
50.000	Eversource Energy	4,25 %	01.04.2029	48.978	0,05
51.000	Exelon Corp	5,10 %	15.06.2045	50.732	0,06
30.000	Expedia Group Inc '144A'	6,25 %	01.05.2025	31.024	0,03
20.000	Farmers Exchange Capital III '144A' FRN		15.10.2054	16.648	0,02
120.000	Federal Realty OP LP	4,50 %	01.12.2044	106.566	0,12
30.000	FedEx Corp	3,40 %	15.02.2028	28.651	0,03
150.000	FedEx Corp	4,10 %	15.04.2043	128.657	0,14
40.000	FedEx Corp	4,10 %	01.02.2045	33.671	0,04
90.000	Fifth Third Bancorp	2,55 %	05.05.2027	82.420	0,09
100.000	Fiserv Inc	3,50 %	01.10.2022	100.076	0,11
100.000	Fiserv Inc	2,75 %	01.07.2024	97.583	0,11
100.000	Fiserv Inc	3,50 %	01.07.2029	91.436	0,10
100.000	Five Corners Funding Trust II '144A'	2,85 %	15.05.2030	87.266	0,10
143.000	Florida Gas Transmission Co LLC '144A'	2,55 %	01.07.2030	121.520	0,13
25.000	Fortune Brands Home & Security Inc	4,00 %	15.06.2025	24.685	0,03
49.000	Fox Corp	5,58 %	25.01.2049	47.475	0,05
50.000	Freeport-McMoRan Inc	4,55 %	14.11.2024	50.171	0,06
50.000	Freeport-McMoRan Inc	4,63 %	01.08.2030	47.123	0,05
40.000	Freeport-McMoRan Inc	5,45 %	15.03.2043	37.481	0,04
25.000	General Mills Inc	4,20 %	17.04.2028	24.764	0,03
25.000	General Motors Co	6,13 %	01.10.2025	25.859	0,03
75.000	General Motors Co	6,25 %	02.10.2043	71.806	0,08

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	General Motors Co	5,20 %	01.04.2045	84.504	0,09
125.000	General Motors Financial Co Inc	3,70 %	09.05.2023	124.987	0,14
40.000	General Motors Financial Co Inc	4,15 %	19.06.2023	39.945	0,04
75.000	General Motors Financial Co Inc	3,95 %	13.04.2024	74.544	0,08
100.000	General Motors Financial Co Inc	4,35 %	17.01.2027	96.040	0,11
90.000	Georgia Power Co	4,30 %	15.03.2042	78.919	0,09
40.000	Georgia-Pacific LLC '144A'	1,75 %	30.09.2025	37.128	0,04
40.000	Gilead Sciences Inc	3,65 %	01.03.2026	39.413	0,04
100.000	Gilead Sciences Inc	1,65 %	01.10.2030	82.268	0,09
100.000	Gilead Sciences Inc	4,00 %	01.09.2036	93.456	0,10
69.000	Gilead Sciences Inc	5,65 %	01.12.2041	74.308	0,08
100.000	Gilead Sciences Inc	4,50 %	01.02.2045	92.705	0,10
125.000	GlaxoSmithKline Capital Inc	2,80 %	18.03.2023	125.012	0,14
50.000	Global Payments Inc	2,90 %	15.05.2030	42.510	0,05
175.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc	5,30 %	15.01.2029	168.054	0,18
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The	3,20 %	23.02.2023	100.081	0,11
140.000	Goldman Sachs Group Inc/The	3,50 %	01.04.2025	137.567	0,15
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The	4,25 %	21.10.2025	99.443	0,11
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The	3,85 %	26.01.2027	96.844	0,11
75.000	Goldman Sachs Group Inc/The	2,60 %	07.02.2030	64.138	0,07
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The	6,75 %	01.10.2037	111.178	0,12
150.000	Goldman Sachs Group Inc/The	6,25 %	01.02.2041	165.857	0,18
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The	4,75 %	21.10.2045	46.760	0,05
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		23.02.2023	39.898	0,04
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		24.07.2023	39.956	0,04
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		17.11.2023	98.753	0,11
75.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		09.12.2026	66.847	0,07
175.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		05.06.2028	165.941	0,18

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
75.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		23.04.2029	70.949	0,08
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		01.05.2029	96.652	0,11
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		27.01.2032	31.727	0,03
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		21.07.2032	81.018	0,09
100.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		21.10.2032	82.808	0,09
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		24.02.2033	42.789	0,05
150.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		23.04.2039	136.681	0,15
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN		22.04.2042	30.647	0,03
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'GMTN' FRN		28.10.2027	49.207	0,05
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'MTN' FRN		29.11.2023	40.162	0,04
50.000	Great-West Lifeco Finance 2018 LP '144A'	4,58 %	17.05.2048	46.217	0,05
20.000	Halliburton Co	3,80 %	15.11.2025	19.888	0,02
50.000	Halliburton Co	7,45 %	15.09.2039	58.683	0,06
50.000	Halliburton Co	4,75 %	01.08.2043	44.556	0,05
20.000	Hartford Financial Services Group Inc/The	2,80 %	19.08.2029	17.838	0,02
50.000	Hartford Financial Services Group Inc/The '144A' FRN		12.02.2047	39.375	0,04
50.000	Hasbro Inc	3,90 %	19.11.2029	46.067	0,05
50.000	HCA Inc	5,00 %	15.03.2024	50.327	0,06
100.000	HCA Inc	5,25 %	15.06.2026	99.622	0,11
50.000	HCA Inc	5,13 %	15.06.2039	44.052	0,05
100.000	HCA Inc	5,50 %	15.06.2047	90.861	0,10
25.000	HCA Inc	5,25 %	15.06.2049	21.677	0,02
100.000	HCA Inc '144A'	4,38 %	15.03.2042	82.020	0,09
140.000	Hess Corp	4,30 %	01.04.2027	136.724	0,15
201.000	Hewlett Packard Enterprise Co	6,35 %	15.10.2045	203.549	0,22
100.000	Home Depot Inc/The	1,38 %	15.03.2031	80.723	0,09
82.000	Home Depot Inc/The	4,20 %	01.04.2043	76.970	0,08
100.000	Home Depot Inc/The	3,35 %	15.04.2050	81.693	0,09

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Hormel Foods Corp	1,80 %	11.06.2030	83.938	0,09
100.000	HP Inc	1,45 %	17.06.2026	88.660	0,10
70.000	HP Inc	3,00 %	17.06.2027	64.934	0,07
25.000	HP Inc	6,00 %	15.09.2041	25.226	0,03
153.000	Humana Inc	3,85 %	01.10.2024	152.576	0,17
25.000	Hyundai Capital America '144A'	2,38 %	10.02.2023	24.676	0,03
40.000	Hyundai Capital America '144A'	5,75 %	06.04.2023	40.565	0,04
40.000	Hyundai Capital America '144A'	1,25 %	18.09.2023	38.758	0,04
100.000	Hyundai Capital America '144A'	1,80 %	15.10.2025	91.502	0,10
140.000	Hyundai Capital America '144A'	2,38 %	15.10.2027	123.465	0,14
25.000	Hyundai Capital America '144A'	6,38 %	08.04.2030	26.767	0,03
80.000	Intel Corp	2,70 %	15.12.2022	80.095	0,09
40.000	Intel Corp	3,40 %	25.03.2025	39.922	0,04
100.000	Intel Corp	3,70 %	29.07.2025	100.312	0,11
100.000	Intel Corp	2,00 %	12.08.2031	83.838	0,09
70.000	Intel Corp	4,60 %	25.03.2040	68.508	0,08
50.000	Intel Corp	4,10 %	19.05.2046	45.607	0,05
25.000	Intel Corp	4,75 %	25.03.2050	24.631	0,03
100.000	Intel Corp	3,05 %	12.08.2051	74.554	0,08
25.000	Intel Corp	4,95 %	25.03.2060	25.506	0,03
50.000	Intercontinental Exchange Inc	3,75 %	01.12.2025	49.755	0,05
50.000	Intercontinental Exchange Inc	2,10 %	15.06.2030	41.985	0,05
50.000	Intercontinental Exchange Inc	4,25 %	21.09.2048	44.801	0,05
100.000	International Business Machines Corp	3,63 %	12.02.2024	100.520	0,11
100.000	International Business Machines Corp	3,45 %	19.02.2026	98.671	0,11
100.000	International Business Machines Corp	3,50 %	15.05.2029	94.862	0,10
40.000	International Business Machines Corp	5,88 %	29.11.2032	44.244	0,05
100.000	International Business Machines Corp	4,25 %	15.05.2049	89.146	0,10

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
40.000	International Flavors & Fragrances Inc '144A'	1,23 %	01.10.2025	36.286	0,04
190.000	International Flavors & Fragrances Inc '144A'	2,30 %	01.11.2030	156.501	0,17
70.000	International Lease Finance Corp	5,88 %	15.08.2022	70.135	0,08
60.000	International Paper Co	7,30 %	15.11.2039	70.343	0,08
75.000	International Paper Co	4,80 %	15.06.2044	69.905	0,08
40.000	Interpublic Group of Cos Inc/The	3,38 %	01.03.2041	30.086	0,03
100.000	Intuit Inc	0,65 %	15.07.2023	97.200	0,11
100.000	J M Smucker Co/The	2,38 %	15.03.2030	85.044	0,09
25.000	J M Smucker Co/The	4,25 %	15.03.2035	23.410	0,03
75.000	Jefferies Group LLC / Jefferies Group Capital Finance Inc	4,15 %	23.01.2030	67.282	0,07
100.000	John Deere Capital Corp	1,45 %	15.01.2031	81.596	0,09
75.000	John Deere Capital Corp 'MTN'	2,45 %	09.01.2030	67.563	0,07
50.000	Johnson & Johnson	2,95 %	03.03.2027	48.969	0,05
100.000	Johnson & Johnson	2,10 %	01.09.2040	73.436	0,08
97.000	Johnson & Johnson	3,50 %	15.01.2048	86.602	0,09
100.000	Johnson & Johnson	2,25 %	01.09.2050	70.414	0,08
150.000	JPMorgan Chase & Co	3,20 %	25.01.2023	150.316	0,16
50.000	JPMorgan Chase & Co	3,88 %	10.09.2024	49.975	0,05
100.000	JPMorgan Chase & Co	3,13 %	23.01.2025	98.625	0,11
42.000	JPMorgan Chase & Co	2,95 %	01.10.2026	40.164	0,04
100.000	JPMorgan Chase & Co	7,63 %	15.10.2026	113.239	0,12
25.000	JPMorgan Chase & Co	4,13 %	15.12.2026	24.770	0,03
50.000	JPMorgan Chase & Co	8,00 %	29.04.2027	57.601	0,06
100.000	JPMorgan Chase & Co	4,25 %	01.10.2027	98.777	0,11
25.000	JPMorgan Chase & Co	3,63 %	01.12.2027	24.099	0,03
200.000	JPMorgan Chase & Co	5,60 %	15.07.2041	209.756	0,23
40.000	JPMorgan Chase & Co	5,40 %	06.01.2042	41.093	0,05
50.000	JPMorgan Chase & Co	5,63 %	16.08.2043	52.091	0,06

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN		24.10.2023	40.005	0,04
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN		16.03.2024	48.937	0,05
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN		23.04.2024	99.710	0,11
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN		23.07.2024	99.494	0,11
125.000	JPMorgan Chase & Co FRN		01.03.2025	122.805	0,13
150.000	JPMorgan Chase & Co FRN		23.06.2025	140.357	0,15
200.000	JPMorgan Chase & Co FRN		15.10.2025	190.812	0,21
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN		13.03.2026	93.581	0,10
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN		22.04.2026	93.724	0,10
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN		19.11.2026	89.083	0,10
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN		22.04.2027	35.718	0,04
125.000	JPMorgan Chase & Co FRN		01.02.2028	120.226	0,13
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN		23.01.2029	93.752	0,10
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN		01.06.2029	43.128	0,05
200.000	JPMorgan Chase & Co FRN		15.10.2030	174.763	0,19
100.000	JPMorgan Chase & Co FRN		04.02.2032	80.161	0,09
175.000	JPMorgan Chase & Co FRN		22.04.2032	147.410	0,16
200.000	JPMorgan Chase & Co FRN		08.11.2032	166.544	0,18
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN		24.07.2038	35.598	0,04
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN		22.04.2041	31.297	0,03
40.000	JPMorgan Chase & Co FRN		22.04.2042	31.127	0,03
54.000	JPMorgan Chase & Co FRN		22.02.2048	48.290	0,05
80.000	JPMorgan Chase & Co FRN		15.11.2048	68.343	0,08
75.000	JPMorgan Chase & Co FRN		22.04.2051	55.261	0,06
75.000	JPMorgan Chase & Co FRN		22.04.2052	57.623	0,06
50.000	Kansas City Southern/Old	4,70 %	01.05.2048	47.569	0,05
40.000	Kellogg Co	3,40 %	15.11.2027	38.357	0,04
40.000	Kellogg Co	2,10 %	01.06.2030	33.305	0,04

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
68.000	Keurig Dr Pepper Inc	3,20 %	01.05.2030	61.035	0,07
250.000	KeyBank NA/Cleveland OH 'BKNT'	3,40 %	20.05.2026	239.709	0,26
100.000	Keysight Technologies Inc	3,00 %	30.10.2029	89.246	0,10
100.000	KeySpan Gas East Corp '144A'	2,74 %	15.08.2026	94.491	0,10
20.000	Kimberly-Clark Corp	3,95 %	01.11.2028	20.026	0,02
100.000	Kimberly-Clark Corp	3,20 %	25.04.2029	95.587	0,10
20.000	Kimberly-Clark Corp	3,10 %	26.03.2030	18.718	0,02
50.000	Kimberly-Clark Corp	6,63 %	01.08.2037	61.064	0,07
50.000	Kimco Realty Corp	2,70 %	01.10.2030	43.156	0,05
50.000	Kinder Morgan Energy Partners LP	5,00 %	15.08.2042	43.837	0,05
100.000	Kinder Morgan Inc	4,30 %	01.06.2025	99.673	0,11
40.000	Kinder Morgan Inc	2,00 %	15.02.2031	32.139	0,04
126.000	Kinder Morgan Inc	5,30 %	01.12.2034	123.418	0,14
150.000	Kinder Morgan Inc 'GMTN'	7,75 %	15.01.2032	175.488	0,19
50.000	KKR Group Finance Co II LLC '144A'	5,50 %	01.02.2043	49.953	0,05
50.000	KLA Corp	3,30 %	01.03.2050	39.441	0,04
100.000	Kohl's Corp	3,38 %	01.05.2031	87.641	0,10
100.000	Kraft Heinz Foods Co '144A'	7,13 %	01.08.2039	111.775	0,12
120.000	Kroger Co/The	4,65 %	15.01.2048	112.938	0,12
100.000	Kyndryl Holdings Inc '144A'	3,15 %	15.10.2031	74.303	0,08
150.000	L3Harris Technologies Inc	1,80 %	15.01.2031	120.410	0,13
30.000	Laboratory Corp of America Holdings	3,25 %	01.09.2024	29.595	0,03
50.000	Laboratory Corp of America Holdings	3,60 %	01.09.2027	48.469	0,05
20.000	Laboratory Corp of America Holdings	2,95 %	01.12.2029	17.838	0,02
20.000	Laboratory Corp of America Holdings	4,70 %	01.02.2045	18.137	0,02
50.000	Lam Research Corp	3,75 %	15.03.2026	49.920	0,05
150.000	Lam Research Corp	4,88 %	15.03.2049	153.067	0,17
100.000	Las Vegas Sands Corp	3,20 %	08.08.2024	94.512	0,10

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
141.000	Lear Corp	3,80 %	15.09.2027	133.532	0,15
100.000	Level 3 Financing Inc '144A'	3,40 %	01.03.2027	87.750	0,10
100.000	Level 3 Financing Inc '144A'	3,88 %	15.11.2029	84.852	0,09
100.000	Liberty Mutual Group Inc '144A'	4,25 %	15.06.2023	99.981	0,11
170.000	Liberty Mutual Group Inc '144A'	4,57 %	01.02.2029	166.808	0,18
100.000	Lincoln National Corp	3,40 %	15.01.2031	89.766	0,10
75.000	Linde Inc/CT	3,20 %	30.01.2026	73.889	0,08
100.000	Lowe's Cos Inc	3,10 %	03.05.2027	94.984	0,10
100.000	Lowe's Cos Inc	1,70 %	15.10.2030	80.555	0,09
55.000	Lowe's Cos Inc	4,05 %	03.05.2047	46.137	0,05
50.000	LYB International Finance III LLC	4,20 %	01.05.2050	41.058	0,05
75.000	Magallanes Inc '144A'	3,43 %	15.03.2024	73.643	0,08
100.000	Magallanes Inc '144A'	3,76 %	15.03.2027	93.996	0,10
100.000	Magallanes Inc '144A'	4,28 %	15.03.2032	89.491	0,10
50.000	Magallanes Inc '144A'	5,05 %	15.03.2042	42.603	0,05
100.000	Magallanes Inc '144A'	5,14 %	15.03.2052	84.616	0,09
40.000	Magellan Midstream Partners LP	3,25 %	01.06.2030	35.440	0,04
52.000	Magellan Midstream Partners LP	3,95 %	01.03.2050	41.377	0,05
250.000	Manufacturers & Traders Trust Co 'BKNT'	3,40 %	17.08.2027	237.047	0,26
69.000	Marathon Oil Corp	4,40 %	15.07.2027	67.702	0,07
150.000	Marathon Oil Corp	6,80 %	15.03.2032	161.534	0,18
45.000	Marathon Oil Corp	5,20 %	01.06.2045	41.551	0,05
30.000	Marathon Petroleum Corp	3,63 %	15.09.2024	30.147	0,03
75.000	Marathon Petroleum Corp	4,70 %	01.05.2025	76.108	0,08
75.000	Markel Corp	4,15 %	17.09.2050	63.487	0,07
6.000	Marriott International Inc/MD	5,75 %	01.05.2025	6.231	0,01
100.000	Mars Inc '144A'	3,95 %	01.04.2049	91.309	0,10
200.000	Marsh & McLennan Cos Inc	2,25 %	15.11.2030	169.628	0,19

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
30.000	Marsh & McLennan Cos Inc	4,75 %	15.03.2039	29.541	0,03
50.000	Martin Marietta Materials Inc	2,40 %	15.07.2031	40.882	0,04
70.000	Martin Marietta Materials Inc	4,25 %	15.12.2047	58.803	0,06
200.000	Marvell Technology Inc	1,65 %	15.04.2026	179.528	0,20
25.000	Masco Corp	1,50 %	15.02.2028	21.034	0,02
100.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A'	3,38 %	15.04.2050	77.067	0,08
40.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A'	3,73 %	15.10.2070	29.397	0,03
75.000	Mastercard Inc	3,30 %	26.03.2027	73.828	0,08
100.000	Mastercard Inc	3,35 %	26.03.2030	95.775	0,10
71.000	Mastercard Inc	3,80 %	21.11.2046	64.400	0,07
11.000	Mastercard Inc	2,95 %	15.03.2051	8.554	0,01
40.000	McCormick & Co Inc/MD	3,40 %	15.08.2027	38.334	0,04
70.000	McCormick & Co Inc/MD	2,50 %	15.04.2030	59.733	0,07
100.000	McDonald's Corp 'MTN'	3,38 %	26.05.2025	99.318	0,11
80.000	McDonald's Corp 'MTN'	4,60 %	26.05.2045	75.720	0,08
100.000	MDC Holdings Inc	6,00 %	15.01.2043	82.902	0,09
126.000	Mead Johnson Nutrition Co	4,13 %	15.11.2025	126.928	0,14
100.000	Medtronic Inc	4,38 %	15.03.2035	99.840	0,11
50.000	Merck & Co Inc	2,80 %	18.05.2023	49.868	0,05
50.000	Merck & Co Inc	2,75 %	10.02.2025	49.370	0,05
50.000	Merck & Co Inc	0,75 %	24.02.2026	45.413	0,05
75.000	Merck & Co Inc	3,40 %	07.03.2029	72.683	0,08
50.000	Merck & Co Inc	2,15 %	10.12.2031	43.091	0,05
60.000	Merck & Co Inc	3,90 %	07.03.2039	56.973	0,06
75.000	Merck & Co Inc	3,70 %	10.02.2045	66.012	0,07
75.000	Merck & Co Inc	2,75 %	10.12.2051	55.255	0,06
100.000	MetLife Inc	3,60 %	10.04.2024	100.211	0,11
40.000	MetLife Inc	4,55 %	23.03.2030	40.494	0,04

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
50.000	MetLife Inc	6,50 %	15.12.2032	57.424	0,06
25.000	MetLife Inc	4,13 %	13.08.2042	22.464	0,02
100.000	MetLife Inc	4,05 %	01.03.2045	88.877	0,10
100.000	MetLife Inc '144A'	9,25 %	08.04.2038	117.813	0,13
150.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A'	0,90 %	08.06.2023	146.914	0,16
150.000	Metropolitan Life Global Funding I '144A'	3,45 %	18.12.2026	145.017	0,16
90.000	Microchip Technology Inc	4,33 %	01.06.2023	90.096	0,10
100.000	Microsoft Corp	2,65 %	03.11.2022	100.127	0,11
50.000	Microsoft Corp	3,63 %	15.12.2023	50.357	0,06
100.000	Microsoft Corp	2,40 %	08.08.2026	96.471	0,11
65.000	Microsoft Corp	4,20 %	03.11.2035	67.124	0,07
40.000	Microsoft Corp	3,45 %	08.08.2036	37.872	0,04
35.000	Microsoft Corp	4,10 %	06.02.2037	35.696	0,04
70.000	Microsoft Corp	3,50 %	15.11.2042	62.934	0,07
200.000	Microsoft Corp	2,53 %	01.06.2050	148.008	0,16
35.000	Microsoft Corp	2,92 %	17.03.2052	27.919	0,03
43.000	MidAmerican Energy Co	3,65 %	15.04.2029	41.863	0,05
150.000	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd '144A'	6,50 %	20.06.2027	147.795	0,16
90.000	Molson Coors Beverage Co	4,20 %	15.07.2046	74.480	0,08
70.000	Mondelez International Inc	1,50 %	04.05.2025	65.361	0,07
75.000	Moody's Corp	3,75 %	24.03.2025	74.916	0,08
50.000	Moody's Corp	2,55 %	18.08.2060	30.916	0,03
100.000	Morgan Stanley	5,00 %	24.11.2025	101.759	0,11
50.000	Morgan Stanley	6,38 %	24.07.2042	57.292	0,06
50.000	Morgan Stanley	4,30 %	27.01.2045	45.010	0,05
70.000	Morgan Stanley	4,38 %	22.01.2047	63.638	0,07
100.000	Morgan Stanley FRN		30.05.2025	93.504	0,10
200.000	Morgan Stanley FRN		22.07.2028	189.448	0,21

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
150.000	Morgan Stanley FRN		22.04.2039	140.649	0,15
100.000	Morgan Stanley 'GMTN'	3,70 %	23.10.2024	99.967	0,11
125.000	Morgan Stanley 'GMTN'	4,00 %	23.07.2025	125.118	0,14
40.000	Morgan Stanley 'GMTN'	3,88 %	27.01.2026	39.481	0,04
100.000	Morgan Stanley 'GMTN'	4,35 %	08.09.2026	99.108	0,11
125.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN		08.05.2024	124.991	0,14
50.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN		20.07.2027	44.016	0,05
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN		24.01.2029	95.088	0,10
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN		23.01.2030	97.425	0,11
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN		21.07.2032	81.165	0,09
50.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN		24.03.2051	54.051	0,06
175.000	Morgan Stanley 'MTN'	3,13 %	27.07.2026	167.122	0,18
100.000	Morgan Stanley 'MTN' FRN		25.01.2024	98.046	0,11
40.000	Motorola Solutions Inc	4,60 %	23.02.2028	39.191	0,04
75.000	MPLX LP	4,88 %	01.12.2024	75.643	0,08
75.000	MPLX LP	1,75 %	01.03.2026	67.636	0,07
75.000	MPLX LP	4,25 %	01.12.2027	72.518	0,08
150.000	MPLX LP	2,65 %	15.08.2030	125.674	0,14
50.000	MPLX LP	5,50 %	15.02.2049	46.961	0,05
50.000	MPLX LP	4,95 %	14.03.2052	43.649	0,05
75.000	Mylan Inc	4,55 %	15.04.2028	71.707	0,08
121.000	Narragansett Electric Co/The '144A'	3,40 %	09.04.2030	114.071	0,13
100.000	Nasdaq Inc	1,65 %	15.01.2031	78.472	0,09
25.000	Nationwide Financial Services Inc '144A'	3,90 %	30.11.2049	20.783	0,02
100.000	NBCUniversal Media LLC	4,45 %	15.01.2043	93.405	0,10
150.000	Nestle Holdings Inc '144A'	3,90 %	24.09.2038	139.137	0,15
100.000	Nestle Holdings Inc 'EMTN'	3,13 %	22.03.2023	100.023	0,11
25.000	New York and Presbyterian Hospital/The	4,02 %	01.08.2045	22.881	0,03

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
75.000	New York Life Global Funding '144A'	2,90 %	17.01.2024	74.357	0,08
50.000	New York Life Global Funding '144A'	1,85 %	01.08.2031	40.736	0,04
25.000	New York Life Insurance Co '144A'	6,75 %	15.11.2039	29.151	0,03
25.000	New York Life Insurance Co '144A'	4,45 %	15.05.2069	21.673	0,02
100.000	Newmont Corp	6,25 %	01.10.2039	110.521	0,12
50.000	Niagara Mohawk Power Corp '144A'	1,96 %	27.06.2030	41.374	0,05
100.000	NIKE Inc	3,25 %	27.03.2040	85.512	0,09
35.000	Nordstrom Inc	5,00 %	15.01.2044	25.113	0,03
50.000	Norfolk Southern Corp	3,80 %	01.08.2028	48.988	0,05
50.000	Norfolk Southern Corp	4,05 %	15.08.2052	43.935	0,05
75.000	Northern Trust Corp	1,95 %	01.05.2030	63.829	0,07
50.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A'	3,85 %	30.09.2047	41.600	0,05
30.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A'	3,63 %	30.09.2059	22.889	0,03
164.000	Novartis Capital Corp	1,75 %	14.02.2025	158.419	0,17
40.000	Novartis Capital Corp	2,00 %	14.02.2027	37.190	0,04
100.000	Novartis Capital Corp	2,75 %	14.08.2050	78.346	0,09
100.000	NSTAR Electric Co	3,20 %	15.05.2027	96.688	0,11
25.000	NVIDIA Corp	2,85 %	01.04.2030	22.875	0,03
100.000	NVIDIA Corp	3,50 %	01.04.2040	87.654	0,10
15.000	NVIDIA Corp	3,70 %	01.04.2060	12.647	0,01
175.000	Office Properties Income Trust	4,50 %	01.02.2025	168.187	0,18
16.000	Omega Healthcare Investors Inc	4,38 %	01.08.2023	16.115	0,02
100.000	Omega Healthcare Investors Inc	3,38 %	01.02.2031	81.178	0,09
30.000	Omnicom Group Inc / Omnicom Capital Inc	3,60 %	15.04.2026	29.236	0,03
100.000	Oncor Electric Delivery Co LLC	3,10 %	15.09.2049	77.867	0,09
40.000	ONEOK Inc	2,75 %	01.09.2024	38.714	0,04
100.000	ONEOK Inc	6,35 %	15.01.2031	104.660	0,11
50.000	ONEOK Inc	4,95 %	13.07.2047	42.940	0,05

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
140.000	ONEOK Partners LP	6,13 %	01.02.2041	134.706	0,15
50.000	Oracle Corp	2,63 %	15.02.2023	49.778	0,05
50.000	Oracle Corp	2,40 %	15.09.2023	49.236	0,05
75.000	Oracle Corp	2,50 %	01.04.2025	71.359	0,08
100.000	Oracle Corp	2,95 %	15.05.2025	95.819	0,11
100.000	Oracle Corp	2,65 %	15.07.2026	92.245	0,10
100.000	Oracle Corp	2,80 %	01.04.2027	91.567	0,10
50.000	Oracle Corp	2,88 %	25.03.2031	41.296	0,05
82.000	Oracle Corp	3,90 %	15.05.2035	68.125	0,07
250.000	Oracle Corp	3,80 %	15.11.2037	195.684	0,21
87.000	Oracle Corp	4,00 %	15.07.2046	65.315	0,07
108.000	Oracle Corp	3,60 %	01.04.2050	75.227	0,08
40.000	Oracle Corp	3,95 %	25.03.2051	30.177	0,03
30.000	Oracle Corp	4,10 %	25.03.2061	21.609	0,02
10.000	O'Reilly Automotive Inc	4,20 %	01.04.2030	9.644	0,01
25.000	O'Reilly Automotive Inc	1,75 %	15.03.2031	19.825	0,02
50.000	Otis Worldwide Corp	2,06 %	05.04.2025	47.362	0,05
100.000	Otis Worldwide Corp	3,11 %	15.02.2040	78.165	0,09
100.000	Owl Rock Capital Corp	4,25 %	15.01.2026	92.695	0,10
100.000	Pacific Gas and Electric Co	4,50 %	01.07.2040	77.475	0,08
97.000	Pacific Gas and Electric Co	4,95 %	01.07.2050	77.983	0,09
25.000	Pacific LifeCorp '144A'	3,35 %	15.09.2050	18.914	0,02
100.000	Paramount Global	4,85 %	01.07.2042	83.614	0,09
58.000	Paramount Global	5,85 %	01.09.2043	54.394	0,06
50.000	Paramount Global	4,90 %	15.08.2044	40.859	0,04
50.000	PayPal Holdings Inc	2,40 %	01.10.2024	48.832	0,05
75.000	PayPal Holdings Inc	2,30 %	01.06.2030	64.756	0,07
25.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A'	4,20 %	01.04.2027	24.416	0,03

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	PepsiCo Inc	3,60 %	01.03.2024	100.448	0,11
50.000	PepsiCo Inc	2,38 %	06.10.2026	47.938	0,05
100.000	PepsiCo Inc	2,75 %	19.03.2030	92.506	0,10
50.000	PepsiCo Inc	2,75 %	21.10.2051	38.675	0,04
100.000	PerkinElmer Inc	3,30 %	15.09.2029	88.855	0,10
30.000	Pfizer Inc	2,75 %	03.06.2026	29.265	0,03
80.000	Pfizer Inc	2,63 %	01.04.2030	73.308	0,08
100.000	Pfizer Inc	2,55 %	28.05.2040	78.641	0,09
20.000	Pfizer Inc	4,13 %	15.12.2046	19.159	0,02
82.000	Phillips 66	3,90 %	15.03.2028	79.749	0,09
40.000	Phillips 66 Co '144A'	3,55 %	01.10.2026	38.909	0,04
100.000	Phillips 66 Co '144A'	3,75 %	01.03.2028	95.451	0,10
100.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp	3,80 %	15.09.2030	88.654	0,10
100.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp	4,70 %	15.06.2044	79.220	0,09
100.000	PNC Financial Services Group Inc/The	2,60 %	23.07.2026	94.668	0,10
112.000	PNC Financial Services Group Inc/The	2,55 %	22.01.2030	97.699	0,11
25.000	President and Fellows of Harvard College	2,52 %	15.10.2050	18.505	0,02
52.000	Principal Financial Group Inc	3,70 %	15.05.2029	48.936	0,05
250.000	Principal Life Global Funding II '144A'	3,00 %	18.04.2026	238.724	0,26
50.000	Procter & Gamble Co/The	3,00 %	25.03.2030	47.261	0,05
40.000	Procter & Gamble Co/The	3,55 %	25.03.2040	36.514	0,04
50.000	Progressive Corp/The	4,20 %	15.03.2048	46.410	0,05
100.000	Prologis LP	2,25 %	15.04.2030	86.784	0,10
100.000	Prologis LP	1,25 %	15.10.2030	79.735	0,09
100.000	Prologis LP	2,13 %	15.10.2050	64.516	0,07
109.000	Prudential Financial Inc	3,94 %	07.12.2049	94.530	0,10
50.000	Prudential Financial Inc FRN		15.09.2042	49.370	0,05
230.000	Prudential Financial Inc FRN		15.06.2043	224.717	0,25

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
71.000	Public Service Co of Colorado	3,20 %	01.03.2050	55.747	0,06
100.000	Qorvo Inc '144A'	3,38 %	01.04.2031	79.671	0,09
75.000	QUALCOMM Inc	2,90 %	20.05.2024	74.759	0,08
75.000	QUALCOMM Inc	3,25 %	20.05.2027	73.489	0,08
40.000	QUALCOMM Inc	4,65 %	20.05.2035	41.101	0,05
40.000	QUALCOMM Inc	4,80 %	20.05.2045	40.722	0,04
25.000	QUALCOMM Inc	3,25 %	20.05.2050	20.613	0,02
150.000	Quanta Services Inc	3,05 %	01.10.2041	104.009	0,11
125.000	Ralph Lauren Corp	2,95 %	15.06.2030	110.259	0,12
100.000	Raymond James Financial Inc	4,65 %	01.04.2030	99.311	0,11
100.000	Realty Income Corp	4,88 %	01.06.2026	102.256	0,11
174.000	Realty Income Corp	3,25 %	15.06.2029	162.432	0,18
60.000	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1,75 %	15.09.2030	48.489	0,05
75.000	Regions Financial Corp	2,25 %	18.05.2025	71.517	0,08
71.000	RELX Capital Inc	4,00 %	18.03.2029	68.861	0,08
100.000	Republic Services Inc	2,30 %	01.03.2030	86.340	0,09
140.000	Republic Services Inc	1,75 %	15.02.2032	110.798	0,12
200.000	Roche Holdings Inc '144A'	2,38 %	28.01.2027	189.322	0,21
200.000	Roche Holdings Inc '144A'	4,00 %	28.11.2044	187.793	0,21
100.000	Rockwell Automation Inc	4,20 %	01.03.2049	92.899	0,10
40.000	Roper Technologies Inc	3,80 %	15.12.2026	39.152	0,04
85.000	Roper Technologies Inc	2,95 %	15.09.2029	75.337	0,08
25.000	Ross Stores Inc	4,60 %	15.04.2025	25.314	0,03
159.000	Ryder System Inc 'MTN'	2,50 %	01.09.2024	152.839	0,17
40.000	S&P Global Inc	3,25 %	01.12.2049	31.386	0,03
20.000	S&P Global Inc	2,30 %	15.08.2060	12.306	0,01
50.000	S&P Global Inc '144A'	4,25 %	01.05.2029	49.602	0,05
100.000	Sabine Pass Liquefaction LLC	5,63 %	15.04.2023	101.012	0,11

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
42.000	Sabine Pass Liquefaction LLC	5,63 %	01.03.2025	42.858	0,05
75.000	Sabine Pass Liquefaction LLC	5,00 %	15.03.2027	75.326	0,08
50.000	Sabra Health Care LP	5,13 %	15.08.2026	48.500	0,05
100.000	Salesforce Inc	1,50 %	15.07.2028	87.541	0,10
130.000	Salesforce Inc	2,90 %	15.07.2051	99.002	0,11
50.000	San Diego Gas & Electric Co	1,70 %	01.10.2030	41.262	0,05
75.000	Santander Holdings USA Inc	3,50 %	07.06.2024	73.786	0,08
100.000	Santander Holdings USA Inc	4,50 %	17.07.2025	99.807	0,11
25.000	Santander Holdings USA Inc	4,40 %	13.07.2027	24.102	0,03
75.000	Schlumberger Holdings Corp '144A'	3,90 %	17.05.2028	70.989	0,08
100.000	Sempra Energy	3,25 %	15.06.2027	95.068	0,10
25.000	SES GLOBAL Americas Holdings Inc '144A'	5,30 %	25.03.2044	21.235	0,02
40.000	Sherwin-Williams Co/The	3,80 %	15.08.2049	32.469	0,04
125.000	Simon Property Group LP	3,50 %	01.09.2025	122.197	0,13
50.000	Simon Property Group LP	3,38 %	15.06.2027	47.616	0,05
50.000	Simon Property Group LP	2,65 %	15.07.2030	42.562	0,05
50.000	Simon Property Group LP	3,25 %	13.09.2049	36.442	0,04
100.000	Smithfield Foods Inc '144A'	4,25 %	01.02.2027	96.500	0,11
100.000	Snap-on Inc	3,10 %	01.05.2050	78.617	0,09
150.000	Southern California Edison Co	4,13 %	01.03.2048	123.567	0,14
50.000	Southern California Edison Co	3,65 %	01.02.2050	38.335	0,04
100.000	Southern California Gas Co	4,30 %	15.01.2049	90.903	0,10
50.000	Southern Co/The	4,40 %	01.07.2046	43.697	0,05
100.000	Southern Co/The FRN		15.01.2051	89.838	0,10
80.000	Southern Power Co	4,15 %	01.12.2025	80.335	0,09
50.000	Southern Power Co	5,15 %	15.09.2041	48.341	0,05
100.000	Southwest Airlines Co	5,13 %	15.06.2027	101.565	0,11
50.000	Stanley Black & Decker Inc	2,30 %	15.03.2030	43.030	0,05

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
50.000	Stanley Black & Decker Inc	2,75 %	15.11.2050	35.327	0,04
40.000	Starbucks Corp	3,10 %	01.03.2023	40.034	0,04
75.000	Starbucks Corp	4,50 %	15.11.2048	68.092	0,07
100.000	State Street Corp FRN		03.12.2029	98.099	0,11
100.000	Stryker Corp	0,60 %	01.12.2023	96.013	0,11
50.000	Swiss Re Treasury US Corp '144A'	4,25 %	06.12.2042	46.365	0,05
100.000	Synchrony Financial	3,70 %	04.08.2026	93.306	0,10
140.000	Sysco Corp	2,40 %	15.02.2030	119.962	0,13
25.000	Sysco Corp	4,85 %	01.10.2045	23.428	0,03
39.000	Sysco Corp	4,45 %	15.03.2048	34.114	0,04
30.000	Sysco Corp	6,60 %	01.04.2050	34.700	0,04
40.000	Target Corp	2,35 %	15.02.2030	35.458	0,04
46.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America '144A'	4,27 %	15.05.2047	41.295	0,05
25.000	Texas Instruments Inc	1,38 %	12.03.2025	23.708	0,03
75.000	Texas Instruments Inc	2,25 %	04.09.2029	67.680	0,07
40.000	Texas Instruments Inc	4,15 %	15.05.2048	38.541	0,04
50.000	Thermo Fisher Scientific Inc	1,22 %	18.10.2024	47.459	0,05
75.000	Time Warner Cable LLC	5,50 %	01.09.2041	66.731	0,07
100.000	Time Warner Cable LLC	4,50 %	15.09.2042	78.404	0,09
25.000	Time Warner Entertainment Co LP	8,38 %	15.03.2023	25.848	0,03
100.000	TJX Cos Inc/The	1,60 %	15.05.2031	80.897	0,09
40.000	T-Mobile USA Inc	2,05 %	15.02.2028	34.700	0,04
100.000	T-Mobile USA Inc	3,88 %	15.04.2030	94.012	0,10
40.000	T-Mobile USA Inc	2,25 %	15.11.2031	32.529	0,04
25.000	T-Mobile USA Inc	4,50 %	15.04.2050	22.355	0,02
50.000	T-Mobile USA Inc	3,30 %	15.02.2051	36.784	0,04
25.000	T-Mobile USA Inc	3,60 %	15.11.2060	18.390	0,02
100.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN'	0,80 %	16.10.2025	91.707	0,10

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
40.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN'	2,15 %	13.02.2030	34.670	0,04
150.000	Tractor Supply Co	1,75 %	01.11.2030	118.070	0,13
50.000	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC	4,60 %	15.03.2048	45.787	0,05
122.000	Travelers Cos Inc/The	4,00 %	30.05.2047	110.001	0,12
75.000	Truist Bank	3,20 %	01.04.2024	74.808	0,08
100.000	Truist Bank 'BKNT'	3,00 %	02.02.2023	100.151	0,11
100.000	Truist Bank 'BKNT'	4,05 %	03.11.2025	100.434	0,11
50.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN		02.03.2027	44.853	0,05
150.000	Truist Financial Corp 'MTN' FRN		07.06.2029	129.004	0,14
50.000	TWDC Enterprises 18 Corp 'GMTN'	4,13 %	01.06.2044	45.458	0,05
100.000	TWDC Enterprises 18 Corp 'MTN'	1,85 %	30.07.2026	92.609	0,10
100.000	TWDC Enterprises 18 Corp 'MTN'	2,95 %	15.06.2027	95.740	0,10
152.000	Unilever Capital Corp	3,10 %	30.07.2025	150.483	0,16
30.000	Unilever Capital Corp	5,90 %	15.11.2032	33.983	0,04
100.000	Union Pacific Corp	2,40 %	05.02.2030	89.173	0,10
50.000	Union Pacific Corp	2,38 %	20.05.2031	43.434	0,05
70.000	Union Pacific Corp	3,84 %	20.03.2060	58.885	0,06
75.000	United Parcel Service Inc	3,90 %	01.04.2025	75.623	0,08
35.000	United Parcel Service Inc	4,45 %	01.04.2030	35.898	0,04
50.000	United Parcel Service Inc	3,40 %	15.11.2046	42.255	0,05
30.000	United Parcel Service Inc	3,40 %	01.09.2049	25.410	0,03
75.000	UnitedHealth Group Inc	3,50 %	15.06.2023	75.281	0,08
50.000	UnitedHealth Group Inc	2,38 %	15.08.2024	49.005	0,05
100.000	UnitedHealth Group Inc	3,45 %	15.01.2027	98.714	0,11
75.000	UnitedHealth Group Inc	3,85 %	15.06.2028	74.897	0,08
150.000	UnitedHealth Group Inc	2,00 %	15.05.2030	128.653	0,14
35.000	UnitedHealth Group Inc	4,75 %	15.07.2045	35.122	0,04
40.000	UnitedHealth Group Inc	4,20 %	15.01.2047	37.706	0,04

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
40.000	UnitedHealth Group Inc	4,25 %	15.04.2047	37.673	0,04
44.000	UnitedHealth Group Inc	3,75 %	15.10.2047	38.133	0,04
125.000	UnitedHealth Group Inc	3,88 %	15.08.2059	108.685	0,12
50.000	US Bancorp	2,40 %	30.07.2024	48.802	0,05
100.000	US Bancorp	1,45 %	12.05.2025	93.890	0,10
121.000	US Bancorp	3,00 %	30.07.2029	110.284	0,12
64.000	Ventas Realty LP	4,75 %	15.11.2030	63.106	0,07
75.000	Verizon Communications Inc	3,38 %	15.02.2025	74.400	0,08
25.000	Verizon Communications Inc	4,13 %	16.03.2027	24.942	0,03
100.000	Verizon Communications Inc	3,00 %	22.03.2027	95.219	0,10
100.000	Verizon Communications Inc	4,02 %	03.12.2029	97.161	0,11
100.000	Verizon Communications Inc	1,68 %	30.10.2030	80.354	0,09
100.000	Verizon Communications Inc	1,75 %	20.01.2031	80.360	0,09
20.000	Verizon Communications Inc	2,36 %	15.03.2032	16.582	0,02
154.000	Verizon Communications Inc	2,36 %	15.03.2032	127.682	0,14
50.000	Verizon Communications Inc	4,27 %	15.01.2036	47.086	0,05
100.000	Verizon Communications Inc	2,65 %	20.11.2040	73.983	0,08
20.000	Verizon Communications Inc	3,40 %	22.03.2041	16.341	0,02
50.000	Verizon Communications Inc	4,86 %	21.08.2046	49.383	0,05
83.000	Verizon Communications Inc	2,88 %	20.11.2050	59.153	0,06
120.000	Verizon Communications Inc	3,55 %	22.03.2051	96.422	0,11
65.000	Verizon Communications Inc	3,00 %	20.11.2060	44.265	0,05
48.000	Verizon Communications Inc	3,70 %	22.03.2061	38.112	0,04
30.000	Verizon Communications Inc FRN		20.03.2026	29.491	0,03
28.000	VF Corp	2,95 %	23.04.2030	24.437	0,03
100.000	Viatis Inc	4,00 %	22.06.2050	66.582	0,07
120.000	VICI Properties LP	5,13 %	15.05.2032	113.348	0,12
100.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A'	4,25 %	01.12.2026	91.750	0,10

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
100.000	Visa Inc	3,15 %	14.12.2025	98.717	0,11
75.000	Visa Inc	2,70 %	15.04.2040	60.442	0,07
100.000	Visa Inc	2,00 %	15.08.2050	67.067	0,07
100.000	VMware Inc	1,00 %	15.08.2024	93.699	0,10
102.000	VMware Inc	3,90 %	21.08.2027	97.837	0,11
40.000	Voya Financial Inc	3,65 %	15.06.2026	38.777	0,04
25.000	Vulcan Materials Co	3,50 %	01.06.2030	22.622	0,03
70.000	Walmart Inc	3,25 %	08.07.2029	67.670	0,07
100.000	Walmart Inc	5,25 %	01.09.2035	111.533	0,12
70.000	Walmart Inc	3,95 %	28.06.2038	67.868	0,07
100.000	Walt Disney Co/The	1,75 %	13.01.2026	93.311	0,10
100.000	Walt Disney Co/The	2,00 %	01.09.2029	86.130	0,09
100.000	Walt Disney Co/The	3,80 %	22.03.2030	96.669	0,11
83.000	Walt Disney Co/The	6,40 %	15.12.2035	97.303	0,11
100.000	Walt Disney Co/The	3,60 %	13.01.2051	84.371	0,09
50.000	Waste Management Inc	3,13 %	01.03.2025	49.584	0,05
30.000	WEA Finance LLC '144A'	4,63 %	20.09.2048	23.143	0,03
40.000	Wells Fargo & Co	5,38 %	02.11.2043	39.302	0,04
100.000	Wells Fargo & Co FRN		30.04.2026	93.865	0,10
100.000	Wells Fargo & Co 'MTN'	3,75 %	24.01.2024	100.314	0,11
60.000	Wells Fargo & Co 'MTN'	4,65 %	04.11.2044	53.950	0,06
75.000	Wells Fargo & Co 'MTN'	4,40 %	14.06.2046	64.963	0,07
125.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN		02.06.2024	122.469	0,13
125.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN		11.02.2026	117.789	0,13
125.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN		22.05.2028	118.719	0,13
25.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN		04.04.2031	24.537	0,03
150.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN		02.03.2033	133.322	0,15
30.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN		04.04.2051	29.631	0,03

## L&amp;G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,97 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 76,34 %) (Fortsetzung)</b>					
80.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN		25.04.2053	74.408	0,08
158.000	Welltower Inc	3,63 %	15.03.2024	156.846	0,17
150.000	Welltower Inc	4,13 %	15.03.2029	143.548	0,16
25.000	Western & Southern Life Insurance Co/The '144A'	5,15 %	15.01.2049	25.628	0,03
40.000	Western Union Co/The	1,35 %	15.03.2026	35.800	0,04
100.000	Whirlpool Corp	4,75 %	26.02.2029	99.851	0,11
50.000	Whirlpool Corp	4,50 %	01.06.2046	42.589	0,05
50.000	Williams Cos Inc/The	4,55 %	24.06.2024	50.502	0,06
59.000	Williams Cos Inc/The	5,40 %	04.03.2044	56.704	0,06
70.000	Williams Cos Inc/The	4,85 %	01.03.2048	63.624	0,07
100.000	WRKCo Inc	3,90 %	01.06.2028	96.866	0,11
100.000	Wyeth LLC	5,95 %	01.04.2037	115.312	0,13
50.000	Xilinx Inc	2,38 %	01.06.2030	44.128	0,05
100.000	Xylem Inc/NY	1,95 %	30.01.2028	88.622	0,10
76.000	Zoetis Inc	3,95 %	12.09.2047	66.152	0,07
25.000	Zoetis Inc	3,00 %	15.05.2050	18.828	0,02
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>				<b>68.813.444</b>	<b>75,24</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>90.144.147</b>	<b>98,57</b>
<b>Gesamtanlagen</b>					
Unternehmensanleihen				90.144.147	98,57
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten*				1.310.953	1,43
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>91.455.100</b>	<b>100,00</b>

**L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2022

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	96,80
Sonstige Vermögenswerte	3,20
	<b>100,00</b>
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 70.549 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 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %)</b>					
<b>Argentinien (30. Juni 2021: 0,94 %)</b>					
900.000	Arcor SAIC 'REGS'	6,00 %	06.07.2023	895.725	0,09
630.000	MSU Energy SA / UGEN SA / UENSA SA 'REGS'	6,88 %	01.02.2025	456.671	0,05
1.650.000	Pampa Energia SA 'REGS'	7,50 %	24.01.2027	1.344.750	0,14
800.000	Transportadora de Gas del Sur SA 'REGS'	6,75 %	02.05.2025	691.900	0,07
770.000	YPF SA 'REGS'	8,75 %	04.04.2024	624.566	0,07
2.100.000	YPF SA 'REGS'	8,50 %	28.07.2025	1.409.625	0,15
1.000.000	YPF SA 'REGS'	6,95 %	21.07.2027	567.500	0,06
1.000.000	YPF SA 'REGS'	7,00 %	15.12.2047	495.000	0,05
1.200.000	YPF SA Step-Up Coupon 'REGS'	4,00 %	12.02.2026	936.000	0,10
1.600.000	YPF SA Step-Up Coupon 'REGS'	2,50 %	30.06.2029	928.000	0,10
850.000	YPF SA Step-Up Coupon 'REGS'	1,50 %	30.09.2033	408.000	0,04
<b>Argentinien insgesamt</b>				<b>8.757.737</b>	<b>0,92</b>
<b>Österreich (30. Juni 2021: 1,10 %)</b>					
1.100.000	Klabin Austria GmbH 'REGS'	5,75 %	03.04.2029	1.038.675	0,11
1.550.000	Klabin Austria GmbH 'REGS'	3,20 %	12.01.2031	1.179.938	0,12
1.000.000	Klabin Austria GmbH 'REGS'	7,00 %	03.04.2049	905.500	0,10
2.013.000	Suzano Austria GmbH	2,50 %	15.09.2028	1.628.014	0,17
733.000	Suzano Austria GmbH	6,00 %	15.01.2029	720.374	0,08
1.150.000	Suzano Austria GmbH	5,00 %	15.01.2030	1.040.462	0,11
1.525.000	Suzano Austria GmbH	3,75 %	15.01.2031	1.231.743	0,13
1.450.000	Suzano Austria GmbH	3,13 %	15.01.2032	1.089.312	0,11
643.000	Suzano Austria GmbH 'REGS'	5,75 %	14.07.2026	650.073	0,07
1.700.000	Suzano Austria GmbH 'REGS'	7,00 %	16.03.2047	1.619.037	0,17
<b>Österreich insgesamt</b>				<b>11.103.128</b>	<b>1,17</b>
<b>Aserbaidshon (30. Juni 2021: 0,11 %)</b>					
625.000	International Bank of Azerbaijan OJSC 'REGS'	3,50 %	01.09.2024	588.281	0,06
<b>Aserbaidshon insgesamt</b>				<b>588.281</b>	<b>0,06</b>

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Bahamas (30. Juni 2021: 0,35 %)</b>					
2.975.000	Competition Team Technologies Ltd	3,75 %	12.03.2024	2.972.769	0,31
<b>Bahamas insgesamt</b>				<b>2.972.769</b>	<b>0,31</b>
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 1,74 %)</b>					
350.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN'	5,00 %	24.05.2023	352.800	0,04
1.000.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN'	2,00 %	15.09.2025	932.500	0,10
1.800.000	CBQ Finance Ltd 'EMTN'	2,00 %	12.05.2026	1.647.000	0,17
1.216.000	Credicorp Ltd 'REGS'	2,75 %	17.06.2025	1.123.888	0,12
1.135.442	Digicel Group Holdings Ltd	10,00 %	01.04.2024	1.091.444	0,11
1.200.000	Digicel Ltd 'REGS'	6,75 %	01.03.2023	720.000	0,07
600.000	Haitong International Securities Group Ltd	3,38 %	19.07.2024	592.612	0,06
800.000	Inkia Energy Ltd 'REGS'	5,88 %	09.11.2027	727.400	0,08
2.100.000	Investment Energy Resources Ltd 'REGS'	6,25 %	26.04.2029	1.780.800	0,19
200.000	Kunlun Energy Co Ltd 'REGS'	3,75 %	13.05.2025	198.406	0,02
1.100.000	Li & Fung Ltd 'EMTN'	4,50 %	18.08.2025	1.037.644	0,11
1.150.000	Li & Fung Ltd 'EMTN' (Perpetual)	5,25 %	03.11.2022	727.375	0,08
1.000.000	Sagikor Financial Co Ltd 'REGS'	5,30 %	13.05.2028	910.000	0,09
1.650.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 'REGS'	4,85 %	14.10.2038	1.398.169	0,15
650.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS'	2,63 %	15.08.2025	550.387	0,06
2.150.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS'	4,00 %	15.08.2026	1.817.825	0,19
1.350.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS'	3,25 %	15.08.2030	995.625	0,10
<b>Bermuda insgesamt</b>				<b>16.603.875</b>	<b>1,74</b>
<b>Brasilien (30. Juni 2021: 3,45 %)</b>					
2.100.000	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao 'REGS'	4,13 %	20.09.2031	1.714.125	0,18
2.500.000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands 'REGS'	3,20 %	27.01.2025	2.388.075	0,25
1.200.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS'	4,50 %	10.01.2025	1.155.000	0,12
550.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS'	2,75 %	11.01.2026	485.925	0,05
850.000	Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 'REGS' FRN		15.02.2029	846.706	0,09
549.000	Banco do Brasil SA/Cayman	3,88 %	10.10.2022	548.417	0,06

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Brasilien (30. Juni 2021: 3,45 %) (Fortsetzung)</b>					
900.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	5,88 %	19.01.2023	907.762	0,10
650.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	4,88 %	19.04.2023	649.844	0,07
1.120.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	4,75 %	20.03.2024	1.115.660	0,12
1.900.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	4,63 %	15.01.2025	1.855.730	0,19
750.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	3,25 %	30.09.2026	678.188	0,07
750.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	4,88 %	11.01.2029	687.900	0,07
1.850.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)		15.04.2023	1.866.534	0,20
1.650.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)		15.04.2024	1.456.125	0,15
2.275.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)		18.06.2024	2.229.500	0,23
900.000	BRF SA 'REGS'	4,88 %	24.01.2030	713.700	0,07
800.000	BRF SA 'REGS'	5,75 %	21.09.2050	532.150	0,06
1.350.000	Cemig Geracao e Transmissao SA 'REGS'	9,25 %	05.12.2024	1.403.409	0,15
800.000	Cosan SA 'REGS'	5,50 %	20.09.2029	737.900	0,08
2.350.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS'	5,13 %	13.05.2023	2.362.220	0,25
1.050.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS'	3,25 %	24.01.2025	997.500	0,10
200.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN		21.11.2029	187.787	0,02
300.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN		15.04.2031	263.100	0,03
2.000.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN (Perpetual)		12.12.2022	1.917.000	0,20
350.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN (Perpetual)		19.03.2023	333.834	0,03
800.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN (Perpetual)		27.02.2025	637.080	0,07
950.000	Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA 'REGS'	4,38 %	18.06.2026	829.350	0,09
1.875.000	Natura Cosméticos SA 'REGS'	4,13 %	03.05.2028	1.547.063	0,16
1.625.000	Oi SA	10,00 %	27.07.2025	747.500	0,08
<b>Brasilien insgesamt</b>				<b>31.795.084</b>	<b>3,34</b>
<b>Britische Jungferninseln (30. Juni 2021: 6,13 %)</b>					
400.000	Bluestar Finance Holdings Ltd	3,38 %	16.07.2024	393.288	0,04
600.000	BOCOM International Blossom Ltd 'EMTN'	1,75 %	28.06.2026	548.160	0,06
1.550.000	CAS Capital No 1 Ltd FRN (Perpetual)		12.07.2026	1.300.063	0,14

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Britische Jungferninseln (30. Juni 2021: 6,13 %) (Fortsetzung)</b>					
2.692.000	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 'REGS'	5,25 %	27.04.2029	2.368.624	0,25
300.000	Central Plaza Development Ltd	4,65 %	19.01.2026	255.619	0,03
700.000	Champion Path Holdings Ltd	4,50 %	27.01.2026	434.000	0,05
1.300.000	Champion Path Holdings Ltd	4,85 %	27.01.2028	743.275	0,08
200.000	China Cinda 2020 I Management Ltd 'EMTN'	1,25 %	20.01.2024	191.218	0,02
750.000	China Cinda 2020 I Management Ltd 'EMTN'	2,50 %	18.03.2025	712.406	0,07
400.000	China Cinda 2020 I Management Ltd 'EMTN'	3,13 %	18.03.2030	340.200	0,04
700.000	China Cinda Finance 2014 Ltd 'REGS'	5,63 %	14.05.2024	716.538	0,07
200.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 'EMTN'	4,10 %	09.03.2024	199.338	0,02
650.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 'EMTN'	4,40 %	09.03.2027	637.731	0,07
250.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 'EMTN'	4,75 %	08.02.2028	245.047	0,03
200.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 'EMTN'	4,75 %	21.02.2029	191.538	0,02
200.000	China Great Wall International Holdings V Ltd	2,38 %	18.08.2030	153.100	0,02
400.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd 'EMTN'	1,75 %	10.08.2023	392.124	0,04
350.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd 'EMTN'	1,63 %	26.01.2024	339.224	0,04
200.000	CITIC Securities Finance MTN Co Ltd 'EMTN'	2,00 %	03.06.2025	189.924	0,02
700.000	CMHI Finance BVI Co Ltd	4,38 %	06.08.2023	705.712	0,07
200.000	CMHI Finance BVI Co Ltd FRN (Perpetual)		09.10.2023	198.225	0,02
200.000	CMS International Gemstone Ltd 'EMTN'	1,30 %	16.09.2024	187.352	0,02
200.000	CNCBINV 1 BVI Ltd	1,75 %	17.11.2024	188.788	0,02
200.000	CSCIF Asia Ltd 'EMTN'	1,75 %	04.08.2025	185.913	0,02
200.000	Ease Trade Global Ltd	4,00 %	10.11.2025	192.912	0,02
1.150.000	Elect Global Investments Ltd (Perpetual)	4,85 %	25.08.2023	920.000	0,10
2.600.000	Elect Global Investments Ltd FRN (Perpetual)		03.06.2025	2.397.363	0,25
400.000	Fortune Star BVI Ltd	5,00 %	18.05.2026	240.000	0,02
592.000	Fortune Star BVI Ltd	5,05 %	27.01.2027	352.240	0,04
240.000	Franshion Brilliant Ltd	3,20 %	09.04.2026	199.200	0,02
200.000	Franshion Brilliant Ltd FRN (Perpetual)		03.01.2023	194.787	0,02
600.000	Fuqing Investment Management Ltd 'EMTN'	3,25 %	23.06.2025	535.237	0,06
1.250.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd 'REGS'	5,13 %	15.05.2024	1.251.406	0,13

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Britische Jungferninseln (30. Juni 2021: 6,13 %) (Fortsetzung)</b>					
750.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd 'REGS'	6,13 %	15.05.2029	752.953	0,08
200.000	GTL Trade Finance Inc 'REGS'	7,25 %	16.04.2044	208.190	0,02
350.000	Henderson Land MTN Ltd 'EMTN'	2,38 %	27.05.2025	330.925	0,03
1.400.000	HKT Capital No 2 Ltd	3,63 %	02.04.2025	1.382.763	0,14
1.950.000	HKT Capital No 4 Ltd	3,00 %	14.07.2026	1.868.709	0,20
1.100.000	HKT Capital No 5 Ltd	3,25 %	30.09.2029	999.988	0,10
2.100.000	HKT Capital No 6 Ltd	3,00 %	18.01.2032	1.787.688	0,19
300.000	Horse Gallop Finance Ltd 'EMTN'	1,10 %	26.07.2024	284.814	0,03
200.000	Horse Gallop Finance Ltd 'EMTN'	1,70 %	28.07.2025	186.538	0,02
400.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd	4,75 %	27.04.2027	359.000	0,04
500.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd 'EMTN'	4,25 %	07.11.2027	433.750	0,05
400.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd 'EMTN'	4,95 %	07.11.2047	278.500	0,03
200.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd 'EMTN' FRN		07.11.2022	198.500	0,02
400.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd 'EMTN' FRN (Perpetual)		07.11.2022	395.500	0,04
200.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	2,13 %	30.09.2023	191.100	0,02
550.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	3,75 %	29.05.2024	525.250	0,05
400.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	3,25 %	13.11.2024	375.000	0,04
200.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	4,50 %	29.05.2029	166.000	0,02
400.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	3,88 %	13.11.2029	315.000	0,03
250.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 'EMTN'	3,38 %	24.02.2030	188.438	0,02
400.000	Huarong Finance II Co Ltd 'EMTN'	5,50 %	16.01.2025	386.500	0,04
200.000	Huarong Finance II Co Ltd 'EMTN'	5,00 %	19.11.2025	188.750	0,02
732.000	Huarong Finance II Co Ltd 'EMTN'	4,63 %	03.06.2026	669.780	0,07
578.000	Huarong Finance II Co Ltd 'EMTN'	4,88 %	22.11.2026	528.870	0,06
1.200.000	Hysan MTN Ltd 'EMTN'	2,82 %	04.09.2029	1.084.350	0,11
500.000	IFC Development Corporate Treasury Ltd	3,63 %	17.04.2029	475.563	0,05
350.000	JGSH Philippines Ltd	4,13 %	09.07.2030	320.534	0,03
1.850.000	Nan Fung Treasury III Ltd (Perpetual)	5,00 %	10.09.2023	1.631.237	0,17
200.000	Nan Fung Treasury Ltd 'EMTN'	5,00 %	05.09.2028	197.350	0,02
900.000	Nan Fung Treasury Ltd 'EMTN'	3,63 %	27.08.2030	776.025	0,08

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Britische Jungferninseln (30. Juni 2021: 6,13 %) (Fortsetzung)</b>					
700.000	Panther Ventures Ltd (Perpetual)	3,50 %	22.12.2023	549.850	0,06
1.500.000	Phoenix Lead Ltd (Perpetual)	4,85 %	23.08.2022	1.387.781	0,15
550.000	Pioneer Reward Ltd	1,30 %	09.04.2024	527.312	0,05
200.000	Pioneer Reward Ltd	2,00 %	09.04.2026	185.500	0,02
200.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd	5,20 %	12.01.2026	91.000	0,01
250.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd	5,13 %	26.07.2026	112.500	0,01
200.000	Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd	2,38 %	13.07.2030	174.140	0,02
200.000	Shanghai Port Group BVI Development Co Ltd	2,85 %	11.09.2029	182.842	0,02
250.000	Shenwan Hongyuan International Finance Ltd	1,80 %	14.07.2026	231.092	0,02
250.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance I Ltd	6,00 %	30.07.2024	142.500	0,01
200.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance II Ltd	5,95 %	04.02.2027	90.350	0,01
607.000	Sino-Ocean Land Treasure III Ltd FRN (Perpetual)		21.09.2022	242.914	0,02
500.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd	4,75 %	05.08.2029	200.000	0,02
600.000	Studio City Finance Ltd 'REGS'	6,00 %	15.07.2025	381.000	0,04
1.124.000	Studio City Finance Ltd 'REGS'	6,50 %	15.01.2028	632.250	0,07
3.050.000	Studio City Finance Ltd 'REGS'	5,00 %	15.01.2029	1.520.806	0,16
2.150.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	0,75 %	28.09.2025	1.956.231	0,20
2.075.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	1,25 %	23.04.2026	1.888.042	0,20
1.625.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	1,00 %	28.09.2027	1.400.953	0,15
2.450.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	1,75 %	23.04.2028	2.152.153	0,23
2.700.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	1,38 %	28.09.2030	2.161.296	0,23
3.800.000	TSMC Global Ltd 'REGS'	2,25 %	23.04.2031	3.215.902	0,34
700.000	Vigorous Champion International Ltd 'EMTN'	4,38 %	10.09.2023	700.581	0,07
750.000	Vigorous Champion International Ltd 'EMTN'	2,75 %	02.06.2025	703.957	0,07
1.000.000	Wharf REIC Finance BVI Ltd 'EMTN'	3,50 %	17.01.2028	960.813	0,10
1.372.000	Wheelock MTN BVI Ltd 'EMTN'	2,38 %	25.01.2026	1.287.365	0,13
200.000	Xingsheng BVI Co Ltd	1,38 %	25.08.2024	189.100	0,02
400.000	Yili Holding Investment Ltd	1,63 %	19.11.2025	366.796	0,04
<b>Britische Jungferninseln insgesamt</b>				<b>59.223.143</b>	<b>6,21</b>

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Kanada (30. Juni 2021: 0,55 %)</b>					
1.000.000	Canacol Energy Ltd 'REGS'	5,75 %	24.11.2028	806.250	0,09
2.100.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS'	5,00 %	18.05.2025	2.114.175	0,22
850.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS'	5,88 %	18.05.2030	893.456	0,09
1.200.000	St Marys Cement Inc Canada 'REGS'	5,75 %	28.01.2027	1.184.100	0,12
<b>Kanada insgesamt</b>				<b>4.997.981</b>	<b>0,52</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 17,46 %)</b>					
1.100.000	ABQ Finance Ltd 'EMTN'	3,13 %	24.09.2024	1.075.250	0,11
200.000	ABQ Finance Ltd 'EMTN'	1,88 %	08.09.2025	185.250	0,02
400.000	ABQ Finance Ltd 'EMTN'	2,00 %	06.07.2026	364.000	0,04
1.950.000	ADCB Finance Cayman Ltd 'EMTN'	4,50 %	06.03.2023	1.957.678	0,21
1.020.000	ADIB Capital Invest 2 Ltd FRN (Perpetual)		20.09.2023	1.041.229	0,11
200.000	Agile Group Holdings Ltd FRN (Perpetual)		07.03.2023	43.000	0,00
1.250.000	AHB Sukuk Co Ltd	4,38 %	19.09.2023	1.255.313	0,13
850.000	AKCB Finance Ltd	4,75 %	09.10.2023	857.395	0,09
200.000	Aldar Sukuk Ltd	4,75 %	29.09.2025	202.475	0,02
1.900.000	Aldar Sukuk No 2 Ltd	3,88 %	22.10.2029	1.806.544	0,19
350.000	Almarai Sukuk Ltd	4,31 %	05.03.2024	349.628	0,04
1.100.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd 'REGS'	5,63 %	07.10.2026	996.737	0,10
600.000	Arabian Centres Sukuk Ltd 'REGS'	5,38 %	26.11.2024	565.987	0,06
500.000	Baidu Inc	1,72 %	09.04.2026	456.757	0,05
400.000	Baidu Inc	3,63 %	06.07.2027	384.848	0,04
200.000	Baidu Inc	2,38 %	23.08.2031	166.626	0,02
842.508	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd 'REGS' (Zero Coupon)	0,00 %	05.06.2034	541.996	0,06
1.050.000	BOS Funding Ltd 'EMTN'	4,00 %	18.09.2024	1.017.056	0,11
384.000	Braskem Finance Ltd	6,45 %	03.02.2024	393.672	0,04
1.150.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd 'EMTN'	3,50 %	16.05.2024	1.142.203	0,12
400.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd 'EMTN'	1,99 %	21.07.2025	376.340	0,04
250.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd 'EMTN'	1,80 %	22.07.2026	227.781	0,02
400.000	CDBL Funding 2 'EMTN'	1,38 %	04.03.2024	383.200	0,04

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 17,46 %) (Fortsetzung)</b>					
200.000	CDBL Funding 2 'EMTN'	2,00 %	04.03.2026	185.664	0,02
200.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	3,00 %	18.07.2024	196.350	0,02
300.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	1,88 %	17.06.2025	280.479	0,03
431.000	China Overseas Finance Cayman III Ltd	5,38 %	29.10.2023	438.219	0,05
200.000	China Overseas Finance Cayman III Ltd	6,38 %	29.10.2043	217.350	0,02
200.000	China Overseas Finance Cayman V Ltd	3,95 %	15.11.2022	200.225	0,02
850.000	China Overseas Finance Cayman VI Ltd	5,95 %	08.05.2024	875.925	0,09
200.000	China Overseas Finance Cayman VI Ltd	6,45 %	11.06.2034	216.975	0,02
400.000	China Overseas Finance Cayman VII Ltd	4,25 %	26.04.2023	401.048	0,04
317.000	China Overseas Finance Cayman VII Ltd	4,75 %	26.04.2028	313.889	0,03
200.000	China Resources Land Ltd 'EMTN'	6,00 %	27.02.2024	205.538	0,02
1.150.000	China Resources Land Ltd 'EMTN' FRN (Perpetual)		09.12.2024	1.120.387	0,12
300.000	China SCE Group Holdings Ltd	7,38 %	09.04.2024	99.000	0,01
200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	6,45 %	07.11.2024	128.000	0,01
200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	6,00 %	16.07.2025	118.500	0,01
200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	5,95 %	20.10.2025	118.000	0,01
500.000	CK Hutchison International 16 Ltd 'REGS'	2,75 %	03.10.2026	480.595	0,05
1.500.000	CK Hutchison International 17 II Ltd 'REGS'	2,75 %	29.03.2023	1.496.970	0,16
350.000	CK Hutchison International 17 Ltd 'REGS'	3,50 %	05.04.2027	344.597	0,04
700.000	CK Hutchison International 19 II Ltd 'REGS'	2,75 %	06.09.2029	634.137	0,07
3.835.000	CK Hutchison International 19 II Ltd 'REGS'	3,38 %	06.09.2049	3.080.157	0,32
700.000	CK Hutchison International 19 Ltd 'REGS'	3,25 %	11.04.2024	697.018	0,07
1.500.000	CK Hutchison International 19 Ltd 'REGS'	3,63 %	11.04.2029	1.442.055	0,15
2.403.000	CK Hutchison International 20 Ltd 'REGS'	2,50 %	08.05.2030	2.113.511	0,22
950.000	CK Hutchison International 20 Ltd 'REGS'	3,38 %	08.05.2050	761.435	0,08
1.000.000	CK Hutchison International 21 Ltd 'REGS'	1,50 %	15.04.2026	921.500	0,10
962.000	CK Hutchison International 21 Ltd 'REGS'	3,13 %	15.04.2041	778.575	0,08
900.000	Cosan Overseas Ltd (Perpetual)	8,25 %	05.11.2022	895.669	0,09
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd	5,40 %	27.05.2025	105.000	0,01
300.000	Country Garden Holdings Co Ltd	3,13 %	22.10.2025	147.750	0,02

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 17,46 %) (Fortsetzung)</b>					
800.000	Country Garden Holdings Co Ltd	7,25 %	08.04.2026	424.400	0,04
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd	2,70 %	12.07.2026	92.000	0,01
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd	5,13 %	14.01.2027	90.000	0,01
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd	4,80 %	06.08.2030	85.000	0,01
400.000	Country Garden Holdings Co Ltd	3,88 %	22.10.2030	166.000	0,02
200.000	Country Garden Holdings Co Ltd	3,30 %	12.01.2031	82.000	0,01
650.000	CSN Inova Ventures 'REGS'	6,75 %	28.01.2028	570.375	0,06
400.000	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd	6,88 %	21.03.2023	401.075	0,04
1.020.000	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd	6,75 %	15.02.2025	997.879	0,10
1.800.000	DIB Sukuk Ltd	3,63 %	06.02.2023	1.799.100	0,19
1.400.000	DIB Sukuk Ltd	2,95 %	20.02.2025	1.358.000	0,14
1.075.000	DIB Sukuk Ltd	2,74 %	16.02.2027	1.009.156	0,11
2.400.000	DIB Sukuk Ltd 'EMTN'	2,95 %	16.01.2026	2.305.950	0,24
1.500.000	DIB Sukuk Ltd 'EMTN'	1,96 %	22.06.2026	1.382.250	0,15
1.400.000	DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd FRN (Perpetual)		22.01.2025	1.419.250	0,15
1.700.000	DIB Tier 1 Sukuk 4 Ltd FRN (Perpetual)		19.05.2026	1.661.750	0,17
1.350.000	Doha Finance Ltd 'EMTN'	2,38 %	31.03.2026	1.244.565	0,13
800.000	EI Sukuk Co Ltd	1,83 %	23.09.2025	749.000	0,08
1.000.000	EI Sukuk Co Ltd 'EMTN'	2,08 %	02.11.2026	925.000	0,10
600.000	EMG SUKUK Ltd	4,56 %	18.06.2024	598.988	0,06
300.000	ENN Energy Holdings Ltd 'REGS'	4,63 %	17.05.2027	301.860	0,03
200.000	ENN Energy Holdings Ltd 'REGS'	2,63 %	17.09.2030	169.975	0,02
2.681.000	Fab Sukuk Co Ltd	3,88 %	22.01.2024	2.681.000	0,28
1.700.000	Fab Sukuk Co Ltd	2,50 %	21.01.2025	1.640.500	0,17
1.850.000	Fab Sukuk Co Ltd	1,41 %	14.01.2026	1.699.688	0,18
1.000.000	Fibria Overseas Finance Ltd	5,50 %	17.01.2027	987.750	0,10
2.850.000	Formosa Group Cayman Ltd	3,38 %	22.04.2025	2.788.191	0,29
950.000	Foxconn Far East Ltd 'EMTN'	1,63 %	28.10.2025	879.348	0,09
1.400.000	Foxconn Far East Ltd 'EMTN'	2,50 %	28.10.2030	1.191.137	0,13
2.000.000	FWD Group Ltd	5,75 %	09.07.2024	1.971.000	0,21

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 17,46 %) (Fortsetzung)</b>					
1.750.000	FWD Group Ltd FRN (Perpetual)		15.12.2022	1.732.828	0,18
1.400.000	FWD Group Ltd FRN (Perpetual)		13.09.2024	1.325.450	0,14
700.000	Geely Automobile Holdings Ltd FRN (Perpetual)		09.12.2024	662.287	0,07
1.250.000	GFH Sukuk Ltd	7,50 %	28.01.2025	1.235.937	0,13
700.000	Grupo Aval Ltd 'REGS'	4,75 %	26.09.2022	697.069	0,07
1.150.000	Grupo Aval Ltd 'REGS'	4,38 %	04.02.2030	895.778	0,09
400.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd/The 'EMTN'	4,50 %	07.10.2025	406.825	0,04
800.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd/The 'EMTN'	2,88 %	27.05.2030	716.150	0,08
4.750.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd/The 'EMTN'	2,25 %	15.07.2031	3.979.550	0,42
400.000	HPHT Finance 17 Ltd	2,75 %	11.09.2022	399.480	0,04
800.000	HPHT Finance 19 Ltd	2,88 %	05.11.2024	780.650	0,08
800.000	HPHT Finance 21 II Ltd	1,50 %	17.09.2026	718.824	0,08
950.000	HPHT Finance 21 Ltd	2,00 %	19.03.2026	880.251	0,09
1.950.000	Hutchison Whampoa International 03/33 Ltd 'REGS'	7,45 %	24.11.2033	2.468.271	0,26
2.775.000	Hutchison Whampoa International 14 Ltd 'REGS'	3,63 %	31.10.2024	2.778.122	0,29
2.111.000	IHS Holding Ltd 'REGS'	5,63 %	29.11.2026	1.729.437	0,18
550.000	IHS Holding Ltd 'REGS'	6,25 %	29.11.2028	438.625	0,05
200.000	KWG Group Holdings Ltd	5,88 %	10.11.2024	39.000	0,00
706.031	Lima Metro Line 2 Finance Ltd 'REGS'	5,88 %	05.07.2034	691.601	0,07
1.715.345	Lima Metro Line 2 Finance Ltd 'REGS'	4,35 %	05.04.2036	1.543.810	0,16
750.000	Link Finance Cayman 2009 Ltd/The 'EMTN'	3,60 %	03.09.2024	748.095	0,08
1.100.000	Link Finance Cayman 2009 Ltd/The 'EMTN'	2,88 %	21.07.2026	1.059.987	0,11
1.600.000	Link Finance Cayman 2009 Ltd/The 'EMTN'	2,75 %	19.01.2032	1.396.368	0,15
400.000	Longfor Group Holdings Ltd	3,95 %	16.09.2029	297.000	0,03
3.936.000	MAF Global Securities Ltd	4,75 %	07.05.2024	3.937.968	0,41
2.900.000	MAF Global Securities Ltd FRN (Perpetual)		07.09.2022	2.892.388	0,30
450.000	MAF Sukuk Ltd	4,64 %	14.05.2029	450.225	0,05
300.000	MAF Sukuk Ltd 'EMTN'	3,93 %	28.02.2030	286.931	0,03
900.000	MAR Sukuk Ltd	2,21 %	02.09.2025	850.500	0,09
1.850.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	4,88 %	06.06.2025	1.380.137	0,15

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 17,46 %) (Fortsetzung)</b>					
200.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	5,25 %	26.04.2026	140.000	0,01
650.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	5,63 %	17.07.2027	438.360	0,05
1.900.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	5,75 %	21.07.2028	1.197.000	0,13
2.250.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'	5,38 %	04.12.2029	1.338.750	0,14
350.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS'	5,38 %	15.05.2024	295.750	0,03
250.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS'	5,25 %	18.06.2025	192.391	0,02
1.750.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS'	5,88 %	15.05.2026	1.328.688	0,14
700.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS'	4,75 %	01.02.2027	494.620	0,05
1.450.000	MTR Corp CI Ltd	2,50 %	02.11.2026	1.387.288	0,15
950.000	Noor Sukuk Co Ltd	4,47 %	24.04.2023	954.750	0,10
1.614.681	Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd 'REGS'	7,35 %	01.12.2026	975.415	0,10
2.200.000	Odebrecht Holdco Finance Ltd 'REGS' (Zero Coupon)	0,00 %	10.09.2058	8.800	0,00
360.511	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd 'REGS'	7,72 %	01.12.2026	86.182	0,01
200.000	Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd FRN (Perpetual)		15.07.2023	198.000	0,02
1.650.000	PCPD Capital Ltd	5,13 %	18.06.2026	1.551.000	0,16
283.500	Poinsettia Finance Ltd 'REGS'	6,63 %	17.06.2031	265.250	0,03
225.000	QIIB Senior Sukuk Ltd 'REGS'	4,26 %	05.03.2024	225.563	0,02
2.574.000	QNB Finance Ltd 'EMTN'	2,63 %	12.05.2025	2.458.427	0,26
250.000	QNB Finance Ltd 'EMTN'	1,63 %	22.09.2025	231.250	0,02
600.000	QNB Finance Ltd 'EMTN'	1,38 %	26.01.2026	544.500	0,06
1.500.000	QNB Finance Ltd 'EMTN'	2,75 %	12.02.2027	1.414.031	0,15
1.900.000	Riyad Sukuk Ltd FRN		25.02.2030	1.819.606	0,19
900.000	Riyad Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual)		16.02.2027	853.875	0,09
1.000.000	Sable International Finance Ltd 'REGS'	5,75 %	07.09.2027	912.300	0,10
1.850.000	Samba Funding Ltd	2,75 %	02.10.2024	1.787.909	0,19
2.800.000	Sands China Ltd	5,13 %	08.08.2025	2.303.000	0,24
1.450.000	Sands China Ltd	4,30 %	08.01.2026	1.148.545	0,12
3.400.000	Sands China Ltd	5,40 %	08.08.2028	2.584.000	0,27
1.300.000	Sands China Ltd	4,88 %	18.06.2030	936.910	0,10
550.000	Sands China Ltd 'REGS'	2,55 %	08.03.2027	396.000	0,04

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 17,46 %) (Fortsetzung)</b>					
500.000	Sands China Ltd 'REGS'	3,10 %	08.03.2029	343.750	0,04
850.000	Sands China Ltd 'REGS'	3,25 %	08.08.2031	549.313	0,06
1.700.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 2 'REGS'	3,47 %	08.04.2023	1.696.600	0,18
1.413.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 2 'REGS'	5,06 %	08.04.2043	1.355.420	0,14
3.850.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 3 'REGS'	4,00 %	08.04.2024	3.855.775	0,40
2.500.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 3 'REGS'	5,50 %	08.04.2044	2.503.594	0,26
1.776.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4	4,22 %	27.01.2024	1.784.880	0,19
2.950.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4	4,72 %	27.09.2028	3.039.238	0,32
1.600.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 5	1,74 %	17.09.2025	1.494.000	0,16
1.602.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 5	2,41 %	17.09.2030	1.404.553	0,15
1.200.000	Shelf Drilling Holdings Ltd 'REGS'	8,25 %	15.02.2025	943.725	0,10
450.000	Shimao Group Holdings Ltd	6,13 %	21.02.2024	47.250	0,01
530.000	Shimao Group Holdings Ltd	5,20 %	30.01.2025	55.650	0,01
200.000	Shimao Group Holdings Ltd	5,60 %	15.07.2026	21.000	0,00
700.000	Shimao Group Holdings Ltd	5,20 %	16.01.2027	73.500	0,01
300.000	Shimao Group Holdings Ltd	3,45 %	11.01.2031	31.500	0,00
1.705.000	Shui On Development Holding Ltd	5,75 %	12.11.2023	1.525.975	0,16
250.000	SIB Sukuk Co III Ltd	4,23 %	18.04.2023	250.500	0,03
900.000	SIB Sukuk Co III Ltd	2,85 %	23.06.2025	869.794	0,09
400.000	Soar Wise Ltd 'EMTN'	1,75 %	30.03.2024	383.132	0,04
250.000	StoneCo Ltd 'REGS'	3,95 %	16.06.2028	197.391	0,02
850.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd 'EMTN'	3,63 %	16.01.2023	850.691	0,09
900.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd 'EMTN'	3,75 %	25.02.2029	868.669	0,09
1.050.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd 'EMTN'	2,88 %	21.01.2030	943.884	0,10
1.250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd 'EMTN'	2,75 %	13.05.2030	1.108.047	0,12
1.550.000	Swire Pacific MTN Financing Ltd 'EMTN'	4,50 %	09.10.2023	1.571.603	0,17
450.000	Swire Pacific MTN Financing Ltd 'EMTN'	3,88 %	21.09.2025	450.084	0,05
200.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	3,80 %	11.02.2025	198.543	0,02
400.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	1,81 %	26.01.2026	369.450	0,04
800.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	3,60 %	19.01.2028	761.024	0,08

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 17,46 %) (Fortsetzung)</b>					
900.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	3,98 %	11.04.2029	854.424	0,09
1.350.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	2,39 %	03.06.2030	1.134.253	0,12
400.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	2,88 %	22.04.2031	344.156	0,04
500.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	3,93 %	19.01.2038	426.500	0,04
750.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	3,68 %	22.04.2041	604.215	0,06
300.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	4,53 %	11.04.2049	263.494	0,03
820.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	3,24 %	03.06.2050	568.773	0,06
400.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	3,84 %	22.04.2051	309.496	0,03
400.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	3,29 %	03.06.2060	266.220	0,03
300.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS'	3,94 %	22.04.2061	227.205	0,02
300.000	Times China Holdings Ltd	5,55 %	04.06.2024	43.500	0,00
1.000.000	Times China Holdings Ltd	6,75 %	08.07.2025	140.000	0,01
200.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	1,63 %	24.09.2025	183.534	0,02
200.000	Well Hope Development Ltd FRN (Perpetual)		19.10.2022	199.500	0,02
300.000	Wynn Macau Ltd 'REGS'	4,88 %	01.10.2024	217.686	0,02
650.000	Wynn Macau Ltd 'REGS'	5,50 %	15.01.2026	449.313	0,05
1.150.000	Wynn Macau Ltd 'REGS'	5,50 %	01.10.2027	736.000	0,08
1.600.000	Wynn Macau Ltd 'REGS'	5,63 %	26.08.2028	985.600	0,10
1.100.000	Wynn Macau Ltd 'REGS'	5,13 %	15.12.2029	671.000	0,07
573.000	XP Inc 'REGS'	3,25 %	01.07.2026	501.919	0,05
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>				<b>171.040.697</b>	<b>17,94</b>
<b>Chile (30. Juni 2021: 2,61 %)</b>					
400.000	Banco de Chile 'REGS'	2,99 %	09.12.2031	334.825	0,04
650.000	Banco de Credito e Inversiones SA 'REGS'	4,00 %	11.02.2023	648.903	0,07
250.000	Banco de Credito e Inversiones SA 'REGS'	3,50 %	12.10.2027	234.031	0,03
650.000	Banco de Credito e Inversiones SA 'REGS'	2,88 %	14.10.2031	535.559	0,06
4.600.000	Banco Santander Chile 'REGS'	2,70 %	10.01.2025	4.380.235	0,46
500.000	Banco Santander Chile 'REGS'	3,18 %	26.10.2031	424.062	0,04
2.050.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA	4,50 %	01.08.2024	2.036.931	0,21

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert US\$	% des Nettover-mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Chile (30. Juni 2021: 2,61 %) (Fortsetzung)</b>					
500.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS'	4,25 %	30.04.2029	448.750	0,05
550.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS'	4,20 %	29.01.2030	488.400	0,05
500.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS'	5,50 %	30.04.2049	414.156	0,04
850.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS'	5,15 %	29.01.2050	693.441	0,07
1.300.000	Cencosud SA 'REGS'	5,15 %	12.02.2025	1.292.785	0,14
1.450.000	Cencosud SA 'REGS'	4,38 %	17.07.2027	1.361.006	0,14
350.000	Colbun SA 'REGS'	3,15 %	19.01.2032	281.155	0,03
1.050.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS'	4,75 %	01.08.2026	1.023.435	0,11
728.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS'	3,05 %	14.09.2032	584.357	0,06
1.100.000	Falabella SA 'REGS'	3,38 %	15.01.2032	896.500	0,09
1.869.806	GNL Quintero SA 'REGS'	4,63 %	31.07.2029	1.793.705	0,19
3.100.000	Interchile SA 'REGS'	4,50 %	30.06.2056	2.540.644	0,27
1.250.000	Inversiones CMPC SA 'REGS'	4,75 %	15.09.2024	1.237.500	0,13
548.000	Inversiones CMPC SA 'REGS'	4,38 %	04.04.2027	522.073	0,06
1.350.000	Inversiones CMPC SA 'REGS'	3,85 %	13.01.2030	1.182.769	0,12
850.000	Inversiones CMPC SA 'REGS'	3,00 %	06.04.2031	682.448	0,07
900.000	Inversiones CMPC SA/Cayman Islands Branch 'REGS'	4,38 %	15.05.2023	899.887	0,09
1.400.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS'	3,50 %	10.09.2051	1.029.263	0,11
500.000	Telefonica Chile SA 'REGS'	3,88 %	12.10.2022	498.844	0,05
350.000	Telefonica Moviles Chile SA 'REGS'	3,54 %	18.11.2031	294.284	0,03
	<b>Chile insgesamt</b>			<b>26.759.948</b>	<b>2,81</b>
<b>China (30. Juni 2021: 0,51 %)</b>					
200.000	Bank of China Ltd/Luxembourg 'EMTN'	1,40 %	28.04.2026	184.262	0,02
200.000	Bank of China Ltd/Paris 'EMTN'	0,95 %	21.09.2023	194.596	0,02
200.000	China Construction Bank Corp/Hong Kong 'EMTN'	1,00 %	04.08.2023	195.148	0,02
200.000	China Construction Bank Corp/Hong Kong 'EMTN'	1,25 %	04.08.2025	187.036	0,02
200.000	China Development Bank Financial Leasing Co Ltd FRN		28.09.2030	189.163	0,02
400.000	China Everbright Bank Co Ltd/Hong Kong 'EMTN'	0,84 %	15.06.2024	380.264	0,04

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>China (30. Juni 2021: 0,51 %) (Fortsetzung)</b>					
750.000	China Everbright Bank Co Ltd/Hong Kong 'EMTN' FRN	2,14 %	03.08.2023	749.906	0,08
400.000	China Minsheng Banking Corp Ltd/Hong Kong 'EMTN' FRN		09.03.2023	399.864	0,04
200.000	China Minsheng Banking Corp Ltd/Hong Kong FRN	3,66 %	22.10.2023	199.688	0,02
500.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Hong Kong 'GMTN'	1,63 %	28.10.2026	462.540	0,05
300.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	3,13 %	16.07.2025	273.000	0,03
<b>China insgesamt</b>				<b>3.415.467</b>	<b>0,36</b>
<b>Kolumbien (30. Juni 2021: 3,15 %)</b>					
700.000	Banco Davivienda SA 'REGS' FRN (Perpetual)		22.04.2031	545.038	0,06
300.000	Banco de Bogota SA 'REGS'	5,38 %	19.02.2023	299.722	0,03
1.727.000	Banco de Bogota SA 'REGS'	6,25 %	12.05.2026	1.632.015	0,17
100.000	Bancolombia SA	5,13 %	11.09.2022	99.550	0,01
650.000	Bancolombia SA	3,00 %	29.01.2025	597.512	0,06
1.450.000	Bancolombia SA FRN		18.12.2029	1.254.975	0,13
1.050.000	Colombia Telecomunicaciones SA ESP 'REGS'	4,95 %	17.07.2030	809.681	0,09
3.925.000	Ecopetrol SA	5,88 %	18.09.2023	3.915.188	0,41
1.650.000	Ecopetrol SA	4,13 %	16.01.2025	1.522.579	0,16
1.980.000	Ecopetrol SA	5,38 %	26.06.2026	1.830.634	0,19
3.900.000	Ecopetrol SA	6,88 %	29.04.2030	3.428.100	0,36
2.430.000	Ecopetrol SA	4,63 %	02.11.2031	1.834.650	0,19
1.159.000	Ecopetrol SA	7,38 %	18.09.2043	945.744	0,10
3.750.000	Ecopetrol SA	5,88 %	28.05.2045	2.539.406	0,27
1.300.000	Ecopetrol SA	5,88 %	02.11.2051	851.500	0,09
1.650.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA 'REGS'	5,50 %	29.04.2026	1.550.794	0,16
1.200.000	Oleoducto Central SA 'REGS'	4,00 %	14.07.2027	992.893	0,11
508.000	SURA Asset Management SA 'REGS'	4,88 %	17.04.2024	503.333	0,05
967.000	Transportadora de Gas Internacional SA ESP 'REGS'	5,55 %	01.11.2028	877.129	0,09
<b>Kolumbien insgesamt</b>				<b>26.030.443</b>	<b>2,73</b>

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Curaçao (30. Juni 2021: 0,19 %)</b>					
326.000	Teva Pharmaceutical Finance Co BV	2,95 %	18.12.2022	321.721	0,03
<b>Curacao insgesamt</b>				<b>321.721</b>	<b>0,03</b>
<b>Hongkong (30. Juni 2021: 4,76 %)</b>					
500.000	AIA Group Ltd 'EMTN'	3,13 %	13.03.2023	499.312	0,05
1.900.000	AIA Group Ltd 'GMTN' FRN (Perpetual)		07.04.2026	1.691.000	0,18
1.300.000	AIA Group Ltd 'REGS'	3,20 %	11.03.2025	1.282.369	0,14
2.050.000	AIA Group Ltd 'REGS'	3,90 %	06.04.2028	2.024.119	0,21
2.400.000	AIA Group Ltd 'REGS'	3,60 %	09.04.2029	2.311.950	0,24
3.000.000	AIA Group Ltd 'REGS'	3,38 %	07.04.2030	2.808.375	0,30
3.650.000	AIA Group Ltd 'REGS'	3,20 %	16.09.2040	2.940.075	0,31
1.400.000	AIA Group Ltd 'REGS'	4,88 %	11.03.2044	1.408.137	0,15
1.650.000	AIA Group Ltd 'REGS'	4,50 %	16.03.2046	1.577.606	0,17
3.650.000	Bank of China Hong Kong Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)		14.09.2023	3.719.350	0,39
3.250.000	Bank of Communications Hong Kong Ltd FRN		08.07.2031	2.994.712	0,31
600.000	Bank of Communications Hong Kong Ltd FRN (Perpetual)		03.03.2025	588.000	0,06
1.200.000	Bank of East Asia Ltd/The 'EMTN' FRN		29.05.2030	1.166.475	0,12
1.222.000	Bank of East Asia Ltd/The 'EMTN' FRN (Perpetual)		21.10.2025	1.179.230	0,12
800.000	Bank of East Asia Ltd/The FRN (Perpetual)		19.09.2024	787.400	0,08
800.000	Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd 'EMTN'	4,88 %	17.08.2026	744.000	0,08
750.000	China CITIC Bank International Ltd 'EMTN' FRN		28.02.2029	753.891	0,08
400.000	China CITIC Bank International Ltd 'EMTN' FRN (Perpetual)		06.11.2023	415.000	0,04
1.350.000	China CITIC Bank International Ltd 'EMTN' FRN (Perpetual)		29.07.2026	1.275.750	0,13
200.000	China Ping An Insurance Overseas Holdings Ltd 'EMTN'	2,85 %	12.08.2031	159.362	0,02
200.000	China Zheshang Bank Co Ltd/Hong Kong 'EMTN'	1,10 %	16.03.2024	190.564	0,02
400.000	CMB International Leasing Management Ltd 'EMTN'	3,00 %	03.07.2024	392.075	0,04
200.000	CMB International Leasing Management Ltd 'EMTN'	1,25 %	16.09.2024	188.362	0,02
300.000	CMB International Leasing Management Ltd 'EMTN'	1,88 %	12.08.2025	279.806	0,03
400.000	Far East Horizon Ltd 'EMTN'	2,63 %	03.03.2024	378.950	0,04

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Hongkong (30. Juni 2021: 4,76 %) (Fortsetzung)</b>					
400.000	GLP China Holdings Ltd 'EMTN'	4,97 %	26.02.2024	397.075	0,04
280.000	GLP China Holdings Ltd 'EMTN'	2,95 %	29.03.2026	251.440	0,03
700.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	3,75 %	05.03.2024	698.819	0,07
450.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	1,63 %	02.11.2024	427.194	0,05
550.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	1,75 %	25.08.2025	513.837	0,05
200.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	1,75 %	02.08.2026	182.118	0,02
650.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN'	2,25 %	02.11.2026	601.354	0,06
500.000	ICBCIL Finance Co Ltd 'EMTN' FRN	2,53 %	20.11.2024	497.594	0,05
200.000	Lenovo Group Ltd 'EMTN'	4,75 %	29.03.2023	201.038	0,02
600.000	Lenovo Group Ltd 'EMTN'	5,88 %	24.04.2025	617.502	0,07
400.000	Lenovo Group Ltd 'REGS'	3,42 %	02.11.2030	341.075	0,04
3.130.000	MTR Corp Ltd 'EMTN'	1,63 %	19.08.2030	2.614.137	0,27
850.000	Nanyang Commercial Bank Ltd FRN		20.11.2029	830.769	0,09
900.000	Swire Pacific Mtn Financing HK Ltd 'EMTN'	2,88 %	30.01.2030	810.450	0,09
1.050.000	Swire Properties MTN Financing Ltd 'EMTN'	3,63 %	13.01.2026	1.041.666	0,11
500.000	Swire Properties MTN Financing Ltd 'EMTN'	3,50 %	10.01.2028	486.656	0,05
600.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 'EMTN'	4,15 %	18.04.2023	595.500	0,06
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 'EMTN'	5,35 %	11.03.2024	199.413	0,02
300.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 'EMTN'	4,20 %	07.06.2024	292.500	0,03
400.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 'EMTN'	3,98 %	09.11.2027	350.700	0,04
400.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 'EMTN' FRN	3,07 %	25.05.2023	396.000	0,04
400.000	Weichai International Hong Kong Energy Group Co Ltd FRN (Perpetual)		14.09.2022	399.950	0,04
400.000	Westwood Group Holdings Ltd 'EMTN'	2,80 %	20.01.2026	365.325	0,04
700.000	Yanlord Land HK Co Ltd	5,13 %	20.05.2026	518.000	0,05
<b>Hongkong insgesamt</b>				<b>45.385.982</b>	<b>4,76</b>
<b>Indien (30. Juni 2021: 3,22 %)</b>					
2.700.000	Adani Green Energy Ltd 'REGS'	4,38 %	08.09.2024	2.419.875	0,25
1.100.000	Adani Green Energy UP Ltd / Prayatna Developers Pvt Ltd / Parampujya Solar Energ 'REGS'	6,25 %	10.12.2024	1.048.987	0,11
1.000.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS'	4,00 %	30.07.2027	921.125	0,10

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Indien (30. Juni 2021: 3,22 %) (Fortsetzung)</b>					
1.150.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS'	4,20 %	04.08.2027	1.067.919	0,11
1.401.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS'	4,38 %	03.07.2029	1.238.834	0,13
900.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS'	3,10 %	02.02.2031	700.481	0,07
700.000	Axis Bank Ltd/Gift City 'REGS' FRN (Perpetual)		08.09.2026	602.000	0,06
300.000	Bharat Petroleum Corp Ltd	4,63 %	25.10.2022	300.619	0,03
900.000	Bharat Petroleum Corp Ltd 'EMTN'	4,00 %	08.05.2025	888.012	0,09
1.800.000	Bharti Airtel Ltd 'REGS'	4,38 %	10.06.2025	1.789.362	0,19
1.650.000	Bharti Airtel Ltd 'REGS'	3,25 %	03.06.2031	1.396.626	0,15
400.000	Delhi International Airport Ltd 'REGS'	6,13 %	31.10.2026	360.200	0,04
200.000	Delhi International Airport Ltd 'REGS'	6,45 %	04.06.2029	158.500	0,02
600.000	Future Retail Ltd 'REGS'	5,60 %	22.01.2025	74.925	0,01
1.200.000	HDFC Bank Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)		25.08.2026	996.000	0,10
500.000	Hindustan Petroleum Corp Ltd	4,00 %	12.07.2027	479.625	0,05
500.000	Indian Oil Corp Ltd	5,75 %	01.08.2023	509.000	0,05
950.000	Indian Oil Corp Ltd	4,75 %	16.01.2024	958.491	0,10
600.000	Indian Railway Finance Corp Ltd	3,84 %	13.12.2027	573.318	0,06
400.000	Indian Railway Finance Corp Ltd 'REGS'	3,57 %	21.01.2032	343.700	0,04
1.472.000	JSW Hydro Energy Ltd 'REGS'	4,13 %	18.05.2031	1.173.920	0,12
250.000	JSW Steel Ltd	5,95 %	18.04.2024	246.875	0,03
600.000	JSW Steel Ltd 'REGS'	3,95 %	05.04.2027	481.500	0,05
700.000	JSW Steel Ltd 'REGS'	5,05 %	05.04.2032	511.000	0,05
750.000	ONGC Videsh Ltd	4,63 %	15.07.2024	753.422	0,08
1.108.000	Power Finance Corp Ltd	4,50 %	18.06.2029	1.033.764	0,11
1.050.000	Power Finance Corp Ltd 'GMTN'	3,35 %	16.05.2031	871.836	0,09
600.000	Power Finance Corp Ltd 'REGS'	6,15 %	06.12.2028	625.800	0,07
1.000.000	Power Finance Corp Ltd 'REGS'	3,95 %	23.04.2030	883.937	0,09
1.100.000	REC Ltd	3,50 %	12.12.2024	1.075.800	0,11
1.150.000	REC Ltd 'GMTN'	3,38 %	25.07.2024	1.126.497	0,12
950.000	REC Ltd 'GMTN'	2,25 %	01.09.2026	851.022	0,09
1.100.000	REC Ltd 'REGS'	5,25 %	13.11.2023	1.113.269	0,12

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Indien (30. Juni 2021: 3,22 %) (Fortsetzung)</b>					
1.300.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	4,13 %	28.01.2025	1.299.025	0,14
1.100.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	3,67 %	30.11.2027	1.062.737	0,11
3.100.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	2,88 %	12.01.2032	2.576.534	0,27
250.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	6,25 %	19.10.2040	280.097	0,03
1.400.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	4,88 %	10.02.2045	1.310.138	0,14
2.927.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	3,63 %	12.01.2052	2.161.041	0,23
1.309.000	Reliance Industries Ltd 'REGS'	3,75 %	12.01.2062	954.824	0,10
300.000	ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries 'REGS'	4,50 %	14.07.2028	234.375	0,02
600.000	Shriram Transport Finance Co Ltd 'REGS'	4,40 %	13.03.2024	555.000	0,06
525.000	Summit Digital Infrastructure Pvt Ltd 'REGS'	2,88 %	12.08.2031	403.468	0,04
<b>Indien insgesamt</b>				<b>38.413.480</b>	<b>4,03</b>
<b>Indonesien (30. Juni 2021: 0,74 %)</b>					
600.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 'EMTN'	3,75 %	11.04.2024	594.300	0,06
250.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 'EMTN'	4,75 %	13.05.2025	251.922	0,03
1.200.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT FRN (Perpetual)		24.03.2027	1.036.632	0,11
750.000	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	4,63 %	20.07.2023	751.958	0,08
1.450.000	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	3,95 %	28.03.2024	1.435.659	0,15
1.500.000	Freeport Indonesia PT 'REGS'	4,76 %	14.04.2027	1.436.250	0,15
2.700.000	Freeport Indonesia PT 'REGS'	5,32 %	14.04.2032	2.450.250	0,26
1.500.000	Freeport Indonesia PT 'REGS'	6,20 %	14.04.2052	1.290.000	0,13
1.857.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	3,40 %	09.06.2031	1.444.022	0,15
1.100.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	3,54 %	27.04.2032	847.121	0,09
1.050.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	4,75 %	09.06.2051	704.928	0,07
3.131.000	Perusahaan Gas Negara Tbk PT 'REGS'	5,13 %	16.05.2024	3.131.313	0,33
<b>Indonesien insgesamt</b>				<b>15.374.355</b>	<b>1,61</b>
<b>International (30. Juni 2021: 0,69 %)</b>					
2.230.000	Canpack SA / Canpack US LLC 'REGS'	3,88 %	15.11.2029	1.717.100	0,18
260.000	Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd 'REGS'	8,75 %	25.05.2024	238.355	0,02

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>International (30. Juni 2021: 0,69 %) (Fortsetzung)</b>					
1.200.000	Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd 'REGS'	8,75 %	25.05.2024	1.107.600	0,12
1.350.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank/The 'EMTN'	4,88 %	23.05.2024	1.285.143	0,13
450.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank/The 'EMTN'	4,13 %	30.06.2028	378.684	0,04
2.650.000	GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC 'REGS'	7,13 %	31.07.2026	2.486.528	0,26
250.000	Promigas SA ESP / Gases del Pacifico SAC 'REGS'	3,75 %	16.10.2029	200.156	0,02
<b>International insgesamt</b>				<b>7.413.566</b>	<b>0,77</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 1,37 %)</b>					
397.000	Aragvi Finance International DAC 'REGS'	8,45 %	29.04.2026	280.332	0,03
3.800.000	C&W Senior Financing DAC 'REGS'	6,88 %	15.09.2027	3.410.500	0,36
<b>Irland insgesamt</b>				<b>3.690.832</b>	<b>0,39</b>
<b>Isle of Man (30. Juni 2021: 0,23 %)</b>					
600.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc	3,38 %	01.11.2028	512.250	0,05
1.116.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc	3,75 %	01.10.2030	933.255	0,10
<b>Isle of Man insgesamt</b>				<b>1.445.505</b>	<b>0,15</b>
<b>Israel (30. Juni 2021: 0,89 %)</b>					
1.105.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN		21.01.2032	933.725	0,10
500.000	Bank Leumi Le-Israel BM '144A' FRN		29.01.2031	438.281	0,05
1.500.000	Energean Israel Finance Ltd '144A'	4,50 %	30.03.2024	1.417.500	0,15
2.579.382	Energean Israel Finance Ltd '144A'	4,88 %	30.03.2026	2.269.856	0,24
3.160.000	Energean Israel Finance Ltd '144A'	5,38 %	30.03.2028	2.656.375	0,28
1.600.000	Energean Israel Finance Ltd '144A'	5,88 %	30.03.2031	1.304.000	0,14
325.000	Leviathan Bond Ltd '144A'	5,75 %	30.06.2023	319.841	0,03
950.000	Leviathan Bond Ltd '144A'	6,13 %	30.06.2025	892.288	0,09
25.000	Leviathan Bond Ltd '144A'	6,50 %	30.06.2027	22.950	0,00
649.208	Leviathan Bond Ltd '144A'	6,75 %	30.06.2030	576.172	0,06
<b>Israel insgesamt</b>				<b>10.830.988</b>	<b>1,14</b>

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Jersey (30. Juni 2021: 1,68 %)</b>					
1.873.242	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	1,75 %	30.09.2027	1.734.959	0,18
2.690.424	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	2,16 %	31.03.2034	2.286.861	0,24
2.255.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	2,63 %	31.03.2036	1.822.745	0,19
2.300.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	3,25 %	30.09.2040	1.814.556	0,19
3.340.874	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	2,94 %	30.09.2040	2.718.636	0,29
600.000	Oriflame Investment Holding Plc 'REGS'	5,13 %	04.05.2026	378.750	0,04
1.250.000	Petrofac Ltd 'REGS'	9,75 %	15.11.2026	992.592	0,10
450.000	West China Cement Ltd	4,95 %	08.07.2026	351.000	0,04
<b>Jersey insgesamt</b>				<b>12.100.099</b>	<b>1,27</b>
<b>Korea, Republik (Südkorea) (30. Juni 2021: 3,52 %)</b>					
1.200.000	Hana Bank 'REGS'	1,25 %	16.12.2026	1.071.036	0,11
1.120.000	Hana Bank 'REGS'	3,25 %	30.03.2027	1.079.960	0,11
1.200.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd 'REGS' FRN		04.02.2032	1.100.100	0,12
1.625.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)		23.04.2023	1.617.687	0,17
1.450.000	Heungkuk Life Insurance Co Ltd FRN (Perpetual)		09.11.2022	1.412.663	0,15
1.250.000	Hyundai Capital Services Inc 'REGS'	3,75 %	05.03.2023	1.250.825	0,13
1.309.000	Hyundai Capital Services Inc 'REGS'	1,25 %	08.02.2026	1.174.317	0,12
1.500.000	Kookmin Bank 'REGS'	1,75 %	04.05.2025	1.412.520	0,15
1.450.000	Kookmin Bank 'REGS'	1,38 %	06.05.2026	1.321.791	0,14
200.000	Kookmin Bank 'REGS'	2,50 %	04.11.2030	168.742	0,02
1.100.000	Kookmin Bank 'REGS' FRN (Perpetual)		02.07.2024	1.057.581	0,11
800.000	Kyobo Life Insurance Co Ltd 'REGS' FRN		24.07.2047	796.900	0,08
1.317.000	LG Chem Ltd 'REGS'	3,25 %	15.10.2024	1.299.919	0,14
800.000	LG Chem Ltd 'REGS'	1,38 %	07.07.2026	715.360	0,08
700.000	LG Chem Ltd 'REGS'	3,63 %	15.04.2029	667.538	0,07
1.200.000	NAVER Corp	1,50 %	29.03.2026	1.081.737	0,11
400.000	NongHyup Bank 'REGS'	1,25 %	20.07.2025	368.576	0,04
950.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS'	3,88 %	05.11.2023	955.795	0,10
200.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS'	3,88 %	24.03.2026	196.230	0,02

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Korea, Republik (Südkorea) (30. Juni 2021: 3,52 %) (Fortsetzung)</b>					
1.500.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS'	1,38 %	21.10.2026	1.354.170	0,14
1.000.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS'	4,38 %	13.04.2032	967.230	0,10
1.000.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' FRN	4,48 %	24.04.2025	1.026.750	0,11
1.350.000	Shinhan Financial Group Co Ltd FRN (Perpetual)		13.08.2023	1.354.472	0,14
1.250.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS'	1,35 %	10.01.2026	1.143.287	0,12
2.050.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN		05.02.2030	1.979.916	0,21
1.350.000	Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)		12.05.2026	1.179.562	0,12
2.700.000	SK Hynix Inc	3,00 %	17.09.2024	2.634.694	0,28
1.150.000	SK Hynix Inc 'REGS'	1,00 %	19.01.2024	1.093.385	0,11
1.050.000	SK Hynix Inc 'REGS'	1,50 %	19.01.2026	940.769	0,10
450.000	SK Hynix Inc 'REGS'	2,38 %	19.01.2031	355.261	0,04
300.000	SK Telecom Co Ltd 'REGS'	3,75 %	16.04.2023	300.549	0,03
1.550.000	Woori Bank 'REGS'	4,75 %	30.04.2024	1.567.728	0,16
588.000	Woori Bank 'REGS'	2,00 %	20.01.2027	540.151	0,06
600.000	Woori Bank 'REGS' FRN (Perpetual)		04.10.2024	575.175	0,06
<b>Korea, Republik (Südkorea) insgesamt</b>				<b>35.762.376</b>	<b>3,75</b>
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 3,71 %)</b>					
231.000	Adecoagro SA 'REGS'	6,00 %	21.09.2027	210.975	0,02
1.300.000	Altice Financing SA 'REGS'	5,00 %	15.01.2028	1.047.592	0,11
4.560.000	Altice Financing SA 'REGS'	5,75 %	15.08.2029	3.659.400	0,38
2.450.000	Amaggi Luxembourg International Sarl 'REGS'	5,25 %	28.01.2028	2.180.194	0,23
515.000	Atento Luxco 1 SA 'REGS'	8,00 %	10.02.2026	364.137	0,04
2.900.000	B2W Digital Lux Sarl 'REGS'	4,38 %	20.12.2030	2.196.388	0,23
900.000	Cosan Luxembourg SA 'REGS'	7,00 %	20.01.2027	901.350	0,09
1.450.000	CSN Resources SA 'REGS'	4,63 %	10.06.2031	1.031.312	0,11
2.400.000	CSN Resources SA 'REGS'	5,88 %	08.04.2032	1.824.000	0,19
1.650.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS'	3,55 %	31.08.2036	1.414.875	0,15
2.100.000	EIG Pearl Holdings Sarl 'REGS'	4,39 %	30.11.2046	1.643.334	0,17
1.648.304	FEL Energy VI Sarl 'REGS'	5,75 %	01.12.2040	1.197.905	0,13

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 3,71 %) (Fortsetzung)</b>					
910.000	FS Luxembourg Sarl 'REGS'	10,00 %	15.12.2025	919.555	0,10
1.600.000	Gol Finance SA 'REGS'	8,00 %	30.06.2026	1.064.000	0,11
280.845	Guara Norte Sarl 'REGS'	5,20 %	15.06.2034	227.888	0,02
750.000	JSM Global Sarl 'REGS'	4,75 %	20.10.2030	567.563	0,06
850.000	Kenbourne Invest SA 'REGS'	6,88 %	26.11.2024	773.128	0,08
3.950.000	MC Brazil Downstream Trading SARL 'REGS'	7,25 %	30.06.2031	3.160.000	0,33
405.000	Millicom International Cellular SA 'REGS'	6,25 %	25.03.2029	350.072	0,04
2.000.000	Millicom International Cellular SA 'REGS'	4,50 %	27.04.2031	1.480.000	0,15
1.000.000	Movida Europe SA 'REGS'	5,25 %	08.02.2031	770.375	0,08
500.000	Nexa Resources SA 'REGS'	6,50 %	18.01.2028	477.594	0,05
1.100.000	Petrorio Luxembourg Trading Sarl 'REGS'	6,13 %	09.06.2026	1.012.000	0,11
400.000	Raizen Fuels Finance SA 'REGS'	5,30 %	20.01.2027	388.640	0,04
500.000	Rede D'or Finance Sarl 'REGS'	4,95 %	17.01.2028	457.281	0,05
400.000	Rede D'or Finance Sarl 'REGS'	4,50 %	22.01.2030	336.625	0,04
435.000	Rumo Luxembourg Sarl 'REGS'	4,20 %	18.01.2032	346.912	0,04
250.000	Simpar Europe SA 'REGS'	5,20 %	26.01.2031	193.328	0,02
200.000	TMK OAO Via TMK Capital SA	4,30 %	12.02.2027	45.000	0,00
550.000	Unigel Luxembourg SA 'REGS'	8,75 %	01.10.2026	543.029	0,06
<b>Luxemburg insgesamt</b>				<b>30.784.452</b>	<b>3,23</b>
<b>Malaysia (30. Juni 2021: 0,83 %)</b>					
1.150.000	Axiata SPV2 Bhd 'EMTN'	4,36 %	24.03.2026	1.161.716	0,12
854.000	Axiata SPV2 Bhd 'EMTN'	2,16 %	19.08.2030	727.394	0,08
1.900.000	Axiata Spv5 Labuan Ltd 'EMTN'	3,06 %	19.08.2050	1.358.927	0,14
2.591.000	CIMB Bank Bhd 'EMTN' FRN		09.10.2024	2.590.676	0,27
550.000	Genm Capital Labuan Ltd 'REGS'	3,88 %	19.04.2031	439.416	0,05
1.200.000	Malayan Banking Bhd 'EMTN' FRN		16.08.2024	1.200.225	0,12
200.000	RHB Bank Bhd 'EMTN'	1,66 %	29.06.2026	183.064	0,02
<b>Malaysia insgesamt</b>				<b>7.661.418</b>	<b>0,80</b>

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Marshallinseln (30. Juni 2021: 0,16 %)</b>					
781.704	Nakilat Inc 'REGS'	6,07 %	31.12.2033	830.463	0,09
3.800.000	Seaspan Corp 'REGS'	5,50 %	01.08.2029	3.057.356	0,32
<b>Marshallinseln insgesamt</b>				<b>3.887.819</b>	<b>0,41</b>
<b>Mauritius (30. Juni 2021: 1,07 %)</b>					
750.000	CA Magnum Holdings 'REGS'	5,38 %	31.10.2026	648.750	0,07
1.250.000	Greenko Investment Co 'REGS'	4,88 %	16.08.2023	1.201.406	0,13
1.512.193	Greenko Power II Ltd 'REGS'	4,30 %	13.12.2028	1.202.193	0,13
1.550.000	Greenko Solar Mauritius Ltd 'REGS'	5,55 %	29.01.2025	1.443.438	0,15
1.850.000	Greenko Solar Mauritius Ltd 'REGS'	5,95 %	29.07.2026	1.632.625	0,17
2.200.000	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd 'REGS'	5,50 %	06.04.2025	2.043.250	0,21
813.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS'	7,00 %	18.12.2025	677.991	0,07
200.000	MTN Mauritius Investments Ltd 'REGS'	4,76 %	11.11.2024	194.100	0,02
2.917.000	MTN Mauritius Investments Ltd 'REGS'	6,50 %	13.10.2026	2.864.676	0,30
609.000	Network i2i Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)		15.01.2025	563.630	0,06
200.000	Network i2i Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)		03.03.2026	168.100	0,02
<b>Mauritius insgesamt</b>				<b>12.640.159</b>	<b>1,33</b>
<b>Mexiko (30. Juni 2021: 9,40 %)</b>					
950.000	Alpek SAB de CV 'REGS'	4,25 %	18.09.2029	847.409	0,09
550.000	Alpek SAB de CV 'REGS'	3,25 %	25.02.2031	440.619	0,05
450.000	Alsea SAB de CV 'REGS'	7,75 %	14.12.2026	425.053	0,04
1.300.000	America Movil SAB de CV	3,63 %	22.04.2029	1.233.619	0,13
1.600.000	America Movil SAB de CV	2,88 %	07.05.2030	1.429.432	0,15
990.000	America Movil SAB de CV	6,38 %	01.03.2035	1.121.175	0,12
1.900.000	America Movil SAB de CV	6,13 %	30.03.2040	2.098.075	0,22
950.000	America Movil SAB de CV	4,38 %	16.07.2042	861.412	0,09
1.100.000	America Movil SAB de CV	4,38 %	22.04.2049	1.017.363	0,11
1.000.000	Banco Inbursa SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa 'REGS'	4,13 %	06.06.2024	983.700	0,10
605.000	Banco Inbursa SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa 'REGS'	4,38 %	11.04.2027	577.321	0,06

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Mexiko (30. Juni 2021: 9,40 %) (Fortsetzung)</b>					
1.300.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)		27.09.2024	1.220.375	0,13
800.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)		24.01.2027	667.150	0,07
1.450.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)		10.01.2028	1.346.506	0,14
800.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)		27.06.2029	724.900	0,08
1.050.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)		14.10.2030	1.011.150	0,11
1.125.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 'REGS' FRN (Perpetual)		24.01.2032	918.141	0,10
600.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS'	4,13 %	09.11.2022	599.925	0,06
3.285.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS'	5,38 %	17.04.2025	3.299.783	0,35
1.538.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' FRN		01.10.2028	1.525.619	0,16
1.050.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS'	6,75 %	30.09.2022	1.049.685	0,11
1.600.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS'	4,38 %	10.04.2024	1.588.300	0,17
1.100.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS'	1,88 %	18.09.2025	996.050	0,10
847.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS' FRN		18.01.2033	718.256	0,07
650.000	BBVA Bancomer SA/Texas 'REGS' FRN		13.09.2034	571.188	0,06
490.000	Becele SAB de CV 'REGS'	2,50 %	14.10.2031	392.398	0,04
650.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS'	7,45 %	15.11.2029	560.137	0,06
1.850.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS'	6,99 %	20.02.2032	1.433.750	0,15
1.900.000	Cemex SAB de CV 'REGS'	7,38 %	05.06.2027	1.885.750	0,20
1.300.000	Cemex SAB de CV 'REGS'	5,45 %	19.11.2029	1.170.000	0,12
1.750.000	Cemex SAB de CV 'REGS'	5,20 %	17.09.2030	1.487.500	0,16
2.800.000	Cemex SAB de CV 'REGS'	3,88 %	11.07.2031	2.108.960	0,22
1.061.000	Cemex SAB de CV 'REGS' FRN (Perpetual)		08.06.2026	900.524	0,09
400.000	Cibanco SA Ibm / PLA Administradora Industrial S de RL de CV 'REGS'	4,96 %	18.07.2029	356.200	0,04
950.000	CIBANCO SA Institucion de Banca Multiple Trust CIB/3332 'REGS'	4,38 %	22.07.2031	673.930	0,07
1.450.000	Coca-Cola Femsa SAB de CV	2,75 %	22.01.2030	1.291.678	0,14
1.100.000	Coca-Cola Femsa SAB de CV	1,85 %	01.09.2032	849.269	0,09
1.100.000	Coca-Cola Femsa SAB de CV	5,25 %	26.11.2043	1.092.644	0,11
826.068	Cometa Energia SA de CV 'REGS'	6,38 %	24.04.2035	804.022	0,08
400.000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	4,38 %	10.05.2043	358.575	0,04

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Mexiko (30. Juni 2021: 9,40 %) (Fortsetzung)</b>					
3.100.000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	3,50 %	16.01.2050	2.418.434	0,25
1.500.000	Grupo Aeromexico SAB de CV 'REGS'	8,50 %	17.03.2027	1.440.000	0,15
975.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS'	3,88 %	27.06.2024	960.253	0,10
1.250.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS'	4,88 %	27.06.2044	1.150.234	0,12
850.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS'	4,70 %	10.11.2047	783.267	0,08
600.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS'	4,00 %	06.09.2049	488.748	0,05
2.326.000	Grupo Bimbo SAB de CV 'REGS' FRN (Perpetual)		17.04.2023	2.273.665	0,24
1.300.000	Grupo Televisa SAB	6,63 %	15.01.2040	1.412.369	0,15
1.500.000	Grupo Televisa SAB	5,00 %	13.05.2045	1.398.750	0,15
2.273.000	Grupo Televisa SAB	6,13 %	31.01.2046	2.515.074	0,26
1.100.000	Grupo Televisa SAB	5,25 %	24.05.2049	1.080.612	0,11
1.150.000	Industrias Penoles SAB de CV 'REGS'	4,15 %	12.09.2029	1.046.356	0,11
1.150.000	Industrias Penoles SAB de CV 'REGS'	5,65 %	12.09.2049	1.024.794	0,11
725.000	Industrias Penoles SAB de CV 'REGS'	4,75 %	06.08.2050	572.206	0,06
700.000	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV 'REGS'	4,88 %	14.01.2048	511.000	0,05
1.700.000	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV 'REGS'	4,75 %	15.01.2051	1.236.733	0,13
900.000	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 'REGS'	2,43 %	01.07.2031	756.000	0,08
950.000	Minera Mexico SA de CV 'REGS'	4,50 %	26.01.2050	736.250	0,08
900.000	Nemak SAB de CV 'REGS'	3,63 %	28.06.2031	624.825	0,07
2.550.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	1,88 %	11.05.2026	2.258.822	0,24
1.050.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	4,00 %	04.10.2027	986.541	0,10
1.000.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	2,88 %	11.05.2031	799.563	0,08
794.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	5,88 %	17.09.2044	707.553	0,07
1.062.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'	5,50 %	15.01.2048	893.275	0,09
1.300.000	Sigma Alimentos SA de CV 'REGS'	4,13 %	02.05.2026	1.214.031	0,13
1.900.000	Trust Fibra Uno 'REGS'	5,25 %	15.12.2024	1.862.356	0,20
1.600.000	Trust Fibra Uno 'REGS'	5,25 %	30.01.2026	1.505.300	0,16
1.865.000	Trust Fibra Uno 'REGS'	4,87 %	15.01.2030	1.575.692	0,16
1.100.000	Trust Fibra Uno 'REGS'	6,95 %	30.01.2044	926.750	0,10
2.350.000	Trust Fibra Uno 'REGS'	6,39 %	15.01.2050	1.869.425	0,20

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Mexiko (30. Juni 2021: 9,40 %) (Fortsetzung)</b>					
550.000	Unifin Financiera SAB de CV 'REGS'	9,88 %	28.01.2029	357.259	0,04
<b>Mexiko insgesamt</b>				<b>80.023.680</b>	<b>8,40</b>
<b>Marokko (30. Juni 2021: 0,32 %)</b>					
900.000	OCP SA 'REGS'	4,50 %	22.10.2025	884.419	0,09
1.606.000	OCP SA 'REGS'	3,75 %	23.06.2031	1.212.530	0,13
1.100.000	OCP SA 'REGS'	6,88 %	25.04.2044	913.206	0,09
1.550.000	OCP SA 'REGS'	5,13 %	23.06.2051	1.025.713	0,11
<b>Marokko insgesamt</b>				<b>4.035.868</b>	<b>0,42</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 7,13 %)</b>					
3.500.000	Bharti Airtel International Netherlands BV 'REGS'	5,35 %	20.05.2024	3.570.656	0,38
800.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS'	4,50 %	10.01.2028	723.212	0,08
2.700.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS'	4,50 %	31.01.2030	2.292.651	0,24
900.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS'	5,88 %	31.01.2050	710.663	0,08
850.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' FRN		23.01.2081	850.956	0,09
2.775.000	Equate Petrochemical BV 'REGS'	4,25 %	03.11.2026	2.719.500	0,29
790.000	Equate Petrochemical BV 'REGS'	2,63 %	28.04.2028	697.175	0,07
1.813.900	Greenko Dutch BV 'REGS'	3,85 %	29.03.2026	1.537.280	0,16
1.450.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS'	8,00 %	18.09.2027	1.261.319	0,13
1.000.000	Metinvest BV 'REGS'	8,50 %	23.04.2026	515.850	0,05
300.000	Metinvest BV 'REGS'	7,75 %	17.10.2029	154.275	0,02
1.600.000	Petrobras Global Finance BV	7,38 %	17.01.2027	1.694.784	0,18
1.275.000	Petrobras Global Finance BV	6,00 %	27.01.2028	1.265.438	0,13
1.500.000	Petrobras Global Finance BV	5,75 %	01.02.2029	1.453.406	0,15
2.280.000	Petrobras Global Finance BV	5,09 %	15.01.2030	2.089.278	0,22
1.150.000	Petrobras Global Finance BV	5,60 %	03.01.2031	1.065.072	0,11
725.000	Petrobras Global Finance BV	6,88 %	20.01.2040	683.675	0,07
850.000	Petrobras Global Finance BV	6,75 %	27.01.2041	787.206	0,08
1.450.000	Petrobras Global Finance BV	7,25 %	17.03.2044	1.371.428	0,14

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 7,13 %) (Fortsetzung)</b>					
1.155.000	Petrobras Global Finance BV	6,90 %	19.03.2049	1.031.993	0,11
1.415.000	Petrobras Global Finance BV	5,50 %	10.06.2051	1.067.971	0,11
2.835.000	Petrobras Global Finance BV	6,85 %	05.06.2115	2.330.724	0,24
206.000	Prosus NV 'REGS'	4,85 %	06.07.2027	189.777	0,02
1.300.000	SABIC Capital I BV	2,15 %	14.09.2030	1.098.500	0,12
695.000	SABIC Capital I BV	3,00 %	14.09.2050	483.025	0,05
2.300.000	SABIC Capital II BV 'REGS'	4,00 %	10.10.2023	2.302.875	0,24
2.300.000	SABIC Capital II BV 'REGS'	4,50 %	10.10.2028	2.312.650	0,24
1.850.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	2,80 %	21.07.2023	1.780.856	0,19
1.000.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	6,00 %	15.04.2024	975.000	0,10
200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7,13 %	31.01.2025	194.163	0,02
4.050.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	3,15 %	01.10.2026	3.321.000	0,35
1.150.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	4,75 %	09.05.2027	983.106	0,10
1.400.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	6,75 %	01.03.2028	1.289.750	0,14
750.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	5,13 %	09.05.2029	617.813	0,07
3.250.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	4,10 %	01.10.2046	1.994.688	0,21
1.750.000	VTR Finance NV 'REGS'	6,38 %	15.07.2028	1.268.750	0,13
<b>Niederlande insgesamt</b>				<b>48.686.465</b>	<b>5,11</b>
<b>Nigeria (30. Juni 2021: 0,10 %)</b>					
950.000	Access Bank Plc 'REGS'	6,13 %	21.09.2026	764.631	0,08
550.000	Access Bank Plc 'REGS' FRN (Perpetual)		07.10.2026	442.750	0,05
950.000	SEPLAT Energy Plc 'REGS'	7,75 %	01.04.2026	845.500	0,09
<b>Nigeria insgesamt</b>				<b>2.052.881</b>	<b>0,22</b>
<b>Oman (30. Juni 2021: 0,26 %)</b>					
400.000	Bank Muscat SAOG 'EMTN'	4,88 %	14.03.2023	397.000	0,04
1.000.000	Bank Muscat SAOG 'EMTN'	4,75 %	17.03.2026	965.000	0,10
300.000	National Bank of Oman SAOG 'EMTN'	5,63 %	25.09.2023	299.025	0,03
<b>Oman insgesamt</b>				<b>1.661.025</b>	<b>0,17</b>

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Panama (30. Juni 2021: 0,68 %)</b>					
3.042.000	AES Panama Generation Holdings SRL 'REGS'	4,38 %	31.05.2030	2.629.049	0,28
250.000	Banistmo SA 'REGS'	3,65 %	19.09.2022	249.578	0,03
2.250.000	Cable Onda SA 'REGS'	4,50 %	30.01.2030	1.856.250	0,19
<b>Panama insgesamt</b>				<b>4.734.877</b>	<b>0,50</b>
<b>Paraguay (30. Juni 2021: 0,16 %)</b>					
1.152.000	Telefonica Celular del Paraguay SA 'REGS'	5,88 %	15.04.2027	1.039.680	0,11
<b>Paraguay insgesamt</b>				<b>1.039.680</b>	<b>0,11</b>
<b>Peru (30. Juni 2021: 1,01 %)</b>					
2.873.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS'	2,70 %	11.01.2025	2.689.846	0,28
900.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS' FRN		01.07.2030	820.575	0,09
150.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS'	4,25 %	01.04.2023	149.934	0,02
650.000	Banco de Credito del Peru S.A. 'REGS' FRN		30.09.2031	568.466	0,06
1.075.000	Cia de Minas Buenaventura SAA 'REGS'	5,50 %	23.07.2026	969.435	0,10
1.074.000	Consorcio Transmantaro SA 'REGS'	4,70 %	16.04.2034	966.600	0,10
1.200.000	Consorcio Transmantaro SA 'REGS'	5,20 %	11.04.2038	1.070.850	0,11
687.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru 'REGS'	6,38 %	01.06.2028	628.090	0,07
1.050.000	InRetail Consumer 'REGS'	3,25 %	22.03.2028	866.447	0,09
650.000	Kallpa Generacion SA 'REGS'	4,13 %	16.08.2027	585.000	0,06
1.150.000	Minsur SA 'REGS'	4,50 %	28.10.2031	964.131	0,10
700.000	Transportadora de Gas del Peru SA 'REGS'	4,25 %	30.04.2028	660.538	0,07
<b>Peru insgesamt</b>				<b>10.939.912</b>	<b>1,15</b>
<b>Philippinen (30. Juni 2021: 0,56 %)</b>					
600.000	Bank of the Philippine Islands 'EMTN'	4,25 %	04.09.2023	601.988	0,06
400.000	BDO Unibank Inc 'EMTN'	2,95 %	06.03.2023	398.200	0,04
1.700.000	BDO Unibank Inc 'EMTN'	2,13 %	13.01.2026	1.574.625	0,16
1.100.000	Globe Telecom Inc FRN (Perpetual)		02.08.2026	1.023.000	0,11
1.100.000	Manila Water Co Inc	4,38 %	30.07.2030	1.008.081	0,11

## L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Philippinen (30. Juni 2021: 0,56 %) (Fortsetzung)</b>					
1.335.000	Metropolitan Bank & Trust Co 'EMTN'	2,13 %	15.01.2026	1.238.212	0,13
300.000	Petron Corp FRN (Perpetual)		19.07.2023	288.619	0,03
350.000	Petron Corp FRN (Perpetual)		19.04.2026	336.503	0,04
1.400.000	Philippine National Bank 'EMTN'	3,28 %	27.09.2024	1.358.263	0,14
350.000	Union Bank of the Philippines 'EMTN'	3,37 %	29.11.2022	348.534	0,04
	<b>Philippinen insgesamt</b>			<b>8.176.025</b>	<b>0,86</b>
<b>Katar (30. Juni 2021: 0,41 %)</b>					
1.645.000	Commercial Bank PSQC/The FRN (Perpetual)		03.03.2026	1.480.500	0,16
1.002.650	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3 'REGS'	6,33 %	30.09.2027	1.042.944	0,11
1.302.300	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3 'REGS'	5,84 %	30.09.2027	1.347.311	0,14
	<b>Katar insgesamt</b>			<b>3.870.755</b>	<b>0,41</b>
<b>Saudi-Arabien (30. Juni 2021: 0,32 %)</b>					
400.000	Arab National Bank FRN		28.10.2030	377.000	0,04
1.300.000	Saudi Telecom Co 'REGS'	3,89 %	13.05.2029	1.262.463	0,13
	<b>Saudi-Arabien insgesamt</b>			<b>1.639.463</b>	<b>0,17</b>
<b>Singapur (30. Juni 2021: 5,62 %)</b>					
1.350.000	BOC Aviation Ltd 'GMTN'	4,00 %	25.01.2024	1.349.393	0,14
1.000.000	BOC Aviation Ltd 'GMTN'	1,75 %	21.01.2026	917.380	0,10
325.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	2,75 %	18.09.2022	324.797	0,03
2.237.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,50 %	10.10.2024	2.211.554	0,23
2.200.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,25 %	29.04.2025	2.146.787	0,23
1.650.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,88 %	27.04.2026	1.623.497	0,17
1.450.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,50 %	18.09.2027	1.392.453	0,15
2.000.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	3,00 %	11.09.2029	1.781.000	0,19
500.000	BOC Aviation Ltd 'REGS'	2,63 %	17.09.2030	425.563	0,05
1.400.000	BOC Aviation Ltd 'REGS' FRN		26.09.2023	1.400.168	0,15
950.000	BPRL International Singapore Pte Ltd 'EMTN'	4,38 %	18.01.2027	924.053	0,10

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Singapur (30. Juni 2021: 5,62 %) (Fortsetzung)</b>					
789.000	Continuum Energy Levanter Pte Ltd 'REGS'	4,50 %	09.02.2027	615.420	0,06
400.000	COSL Singapore Capital Ltd 'EMTN'	4,50 %	30.07.2025	406.296	0,04
1.200.000	DBS Group Holdings Ltd 'GMTN' FRN		10.03.2031	1.092.828	0,12
2.225.000	DBS Group Holdings Ltd 'GMTN' FRN (Perpetual)		27.02.2025	2.097.063	0,22
1.800.000	DBS Group Holdings Ltd 'REGS'	1,19 %	15.03.2027	1.604.988	0,17
1.150.000	DBS Group Holdings Ltd 'REGS' FRN		11.12.2028	1.157.279	0,12
3.450.000	Flex Ltd	4,75 %	15.06.2025	3.458.798	0,36
1.125.000	Flex Ltd	3,75 %	01.02.2026	1.073.531	0,11
1.500.000	Flex Ltd	4,88 %	15.06.2029	1.447.500	0,15
1.970.000	Flex Ltd	4,88 %	12.05.2030	1.875.563	0,20
2.200.000	GLP Pte Ltd 'EMTN'	3,88 %	04.06.2025	2.118.666	0,22
1.400.000	GLP Pte Ltd FRN (Perpetual)		17.05.2026	1.181.950	0,12
1.300.000	Medco Bell Pte Ltd 'REGS'	6,38 %	30.01.2027	1.098.500	0,12
1.200.000	Medco Oak Tree Pte Ltd 'REGS'	7,38 %	14.05.2026	1.089.000	0,11
250.000	Medco Platinum Road Pte Ltd 'REGS'	6,75 %	30.01.2025	231.766	0,02
1.200.000	ONGC Videsh Vankorneft Pte Ltd	3,75 %	27.07.2026	1.155.225	0,12
1.700.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 'REGS'	4,25 %	19.06.2024	1.708.687	0,18
2.050.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 'REGS' FRN		10.09.2030	1.886.984	0,20
1.700.000	Singapore Airlines Ltd 'EMTN'	3,00 %	20.07.2026	1.617.074	0,17
1.200.000	Singapore Telecommunications Ltd 'REGS'	7,38 %	01.12.2031	1.517.100	0,16
1.200.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	3,25 %	30.06.2025	1.185.600	0,12
1.350.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	2,38 %	03.10.2026	1.280.222	0,13
500.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	3,88 %	28.08.2028	499.781	0,05
1.850.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	2,38 %	28.08.2029	1.665.925	0,18
1.900.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd 'EMTN'	1,88 %	10.06.2030	1.626.638	0,17
550.000	United Overseas Bank Ltd 'EMTN' FRN (Perpetual)		19.10.2023	542.369	0,06
1.250.000	United Overseas Bank Ltd 'GMTN' FRN		16.03.2031	1.132.012	0,12
978.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS'	3,06 %	07.04.2025	964.288	0,10
1.650.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS'	1,25 %	14.04.2026	1.509.998	0,16
1.250.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN		15.04.2029	1.239.687	0,13

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Singapur (30. Juni 2021: 5,62 %) (Fortsetzung)</b>					
1.450.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN		14.10.2031	1.307.726	0,14
822.000	United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN		07.10.2032	788.816	0,08
500.000	Vena Energy Capital Pte Ltd 'EMTN'	3,13 %	26.02.2025	476.187	0,05
<b>Singapur insgesamt</b>				<b>57.150.112</b>	<b>6,00</b>
<b>Südafrika (30. Juni 2021: 0,10 %)</b>					
1.470.000	Absa Group Ltd FRN (Perpetual)		27.05.2026	1.335.863	0,14
525.000	FirstRand Bank Ltd FRN		23.04.2028	516.895	0,05
<b>Südafrika insgesamt</b>				<b>1.852.758</b>	<b>0,19</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: 0,29 %)</b>					
2.600.000	Al Candelaria Spain SA 'REGS'	5,75 %	15.06.2033	1.891.500	0,20
2.560.000	EnfraGen Energia Sur SA / EnfraGen Spain SA / Prime Energia SpA 'REGS'	5,38 %	30.12.2030	1.747.200	0,18
<b>Spanien insgesamt</b>				<b>3.638.700</b>	<b>0,38</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 0,16 %)</b>					
650.000	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA Via PKO Finance AB 'REGS'	4,63 %	26.09.2022	650.934	0,07
<b>Schweden insgesamt</b>				<b>650.934</b>	<b>0,07</b>
<b>Thailand (30. Juni 2021: 1,86 %)</b>					
600.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS'	5,00 %	03.10.2023	610.800	0,06
1.475.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS'	4,05 %	19.03.2024	1.483.573	0,16
650.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS'	4,30 %	15.06.2027	652.340	0,07
500.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS'	4,45 %	19.09.2028	502.125	0,05
1.750.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN		25.09.2034	1.528.844	0,16
200.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN		23.09.2036	166.418	0,02
800.000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong 'REGS' FRN (Perpetual)		23.09.2025	728.400	0,08
400.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS'	2,98 %	18.03.2031	333.575	0,03
2.512.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS'	4,40 %	30.03.2032	2.285.950	0,24
1.400.000	GC Treasury Center Co Ltd 'REGS'	4,30 %	18.03.2051	1.072.138	0,11

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Thailand (30. Juni 2021: 1,86 %) (Fortsetzung)</b>					
1.500.000	Kasikornbank PCL/Hong Kong 'EMTN' FRN		02.10.2031	1.352.156	0,14
400.000	Kasikornbank PCL/Hong Kong 'EMTN' FRN (Perpetual)		14.10.2025	366.575	0,04
550.000	Krung Thai Bank PCL/Cayman Islands FRN (Perpetual)		25.03.2026	475.750	0,05
400.000	PTT Global Chemical PCL 'REGS'	4,25 %	19.09.2022	400.575	0,04
700.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd 'REGS'	2,59 %	10.06.2027	649.131	0,07
1.000.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd 'REGS'	3,90 %	06.12.2059	771.040	0,08
1.200.000	Siam Commercial Bank PCL/Cayman Islands 'GMTN'	3,90 %	11.02.2024	1.203.600	0,13
2.250.000	Siam Commercial Bank PCL/Cayman Islands 'GMTN'	4,40 %	11.02.2029	2.251.828	0,24
950.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS'	5,38 %	20.11.2048	808.602	0,08
1.200.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS'	3,50 %	17.10.2049	773.475	0,08
1.300.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS'	3,75 %	18.06.2050	864.266	0,09
<b>Thailand insgesamt</b>				<b>19.281.161</b>	<b>2,02</b>
<b>Togo (30. Juni 2021: 0,07 %)</b>					
200.000	Ecobank Transnational Inc 'REGS'	9,50 %	18.04.2024	193.663	0,02
<b>Togo insgesamt</b>				<b>193.663</b>	<b>0,02</b>
<b>Türkei (30. Juni 2021: 4,09 %)</b>					
350.000	Akbank TAS 'REGS'	5,13 %	31.03.2025	308.175	0,03
1.433.000	Akbank TAS 'REGS'	6,80 %	06.02.2026	1.265.787	0,13
250.000	Akbank TAS 'REGS' FRN		22.06.2031	210.672	0,02
2.250.000	Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS 'REGS'	3,38 %	29.06.2028	1.557.141	0,16
800.000	Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS'	7,75 %	02.02.2027	568.400	0,06
1.100.000	Coca-Cola Icecek AS 'REGS'	4,50 %	20.01.2029	878.144	0,09
200.000	Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS 'REGS'	5,38 %	15.11.2024	184.850	0,02
350.000	QNB Finansbank AS 'REGS'	6,88 %	07.09.2024	349.081	0,04
750.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS'	4,88 %	19.06.2024	660.844	0,07
1.000.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS'	6,88 %	28.02.2025	888.000	0,09
200.000	Turkcell İletişim Hizmetleri AS 'REGS'	5,75 %	15.10.2025	174.750	0,02
1.150.000	Turkcell İletişim Hizmetleri AS 'REGS'	5,80 %	11.04.2028	896.856	0,09

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Türkei (30. Juni 2021: 4,09 %) (Fortsetzung)</b>					
900.000	Türkiye Garanti Bankasi AS 'REGS'	5,25 %	13.09.2022	886.950	0,09
1.984.000	Türkiye Garanti Bankasi AS 'REGS' FRN		24.05.2027	1.683.672	0,18
1.350.000	Türkiye Is Bankasi AS FRN		22.01.2030	1.212.300	0,13
1.425.000	Türkiye Is Bankasi AS 'REGS'	6,13 %	25.04.2024	1.316.611	0,14
600.000	Türkiye Is Bankasi AS 'REGS' FRN		29.06.2028	543.487	0,06
1.900.000	Türkiye Petrol Rafinerileri AS 'REGS'	4,50 %	18.10.2024	1.709.763	0,18
1.550.000	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS 'REGS'	6,95 %	14.03.2026	1.374.947	0,14
1.250.000	Türkiye Vakıflar Bankasi TAO 'REGS'	5,75 %	30.01.2023	1.225.234	0,13
1.075.000	Türkiye Vakıflar Bankasi TAO 'REGS'	8,13 %	28.03.2024	1.027.700	0,11
2.016.000	Türkiye Vakıflar Bankasi TAO 'REGS'	6,50 %	08.01.2026	1.738.548	0,18
700.000	Türkiye Vakıflar Bankasi TAO 'REGS'	5,50 %	01.10.2026	569.756	0,06
2.749.000	Ulker Biskuvi Sanayi AS 'REGS'	6,95 %	30.10.2025	2.117.245	0,22
675.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS'	5,50 %	06.12.2022	661.837	0,07
350.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS'	6,10 %	16.03.2023	341.600	0,04
250.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS'	5,85 %	21.06.2024	230.203	0,02
1.100.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS'	8,25 %	15.10.2024	1.048.644	0,11
1.150.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS' FRN		22.01.2031	1.020.841	0,11
1.100.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 'REGS' FRN (Perpetual)		15.01.2024	1.119.250	0,12
	<b>Türkei insgesamt</b>			<b>27.771.288</b>	<b>2,91</b>
<b>Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2021: 2,02 %)</b>					
200.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	3,50 %	31.03.2027	193.500	0,02
1.980.000	Abu Dhabi Ports Co PJSC 'EMTN'	2,50 %	06.05.2031	1.690.177	0,18
1.050.000	Commercial Bank of Dubai PSC FRN (Perpetual)		21.04.2026	1.036.875	0,11
1.000.000	Emirates NBD Bank PJSC	1,64 %	13.01.2026	922.800	0,10
1.450.000	Emirates NBD Bank PJSC 'EMTN'	2,63 %	18.02.2025	1.406.500	0,15
1.750.000	Emirates NBD Bank PJSC FRN (Perpetual)		20.03.2025	1.750.000	0,18
1.250.000	Emirates NBD Bank PJSC FRN (Perpetual)		09.04.2026	1.252.188	0,13
600.000	Emirates NBD Bank PJSC FRN (Perpetual)		27.02.2027	552.000	0,06
450.000	Emirates Telecommunications Group Co PJSC 'GMTN'	3,50 %	18.06.2024	444.881	0,05

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Arabische Emirate (30. Juni 2021: 2,02 %) (Fortsetzung)</b>					
1.400.000	First Abu Dhabi Bank PJSC 'EMTN' FRN		08.07.2024	1.399.300	0,15
1.200.000	First Abu Dhabi Bank PJSC FRN (Perpetual)		05.04.2026	1.156.500	0,12
300.000	Kuwait Projects Co SPC Ltd	4,23 %	29.10.2026	249.000	0,03
800.000	Mashreqbank PSC 'EMTN'	4,25 %	26.02.2024	798.000	0,08
900.000	NBK SPC Ltd 'REGS' FRN		15.09.2027	802.935	0,08
1.800.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)		27.08.2025	1.674.000	0,17
1.500.000	NBK Tier 1 Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)		24.08.2026	1.345.594	0,14
2.400.000	Oztel Holdings SPC Ltd 'REGS'	5,63 %	24.10.2023	2.403.450	0,25
850.000	Oztel Holdings SPC Ltd 'REGS'	6,63 %	24.04.2028	853.081	0,09
1.850.000	Sweihaan PV Power Co PJSC 'REGS'	3,63 %	31.01.2049	1.527.175	0,16
900.000	Tabreed Sukuk Spc Ltd	5,50 %	31.10.2025	931.106	0,10
<b>Vereinigte Arabische Emirate insgesamt</b>				<b>22.389.062</b>	<b>2,35</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 0,80 %)</b>					
2.250.000	Antofagasta Plc 'REGS'	2,38 %	14.10.2030	1.746.563	0,18
1.050.000	Avianca Midco 2 Ltd 'REGS'	9,00 %	01.12.2028	906.806	0,09
600.000	Bidvest Group UK Plc/The 'REGS'	3,63 %	23.09.2026	526.613	0,06
900.000	Endeavour Mining Plc 'REGS'	5,00 %	14.10.2026	721.687	0,08
1.700.000	Fresnillo Plc 'REGS'	4,25 %	02.10.2050	1.246.631	0,13
450.000	Liquid Telecommunications Financing Plc 'REGS'	5,50 %	04.09.2026	393.750	0,04
1.000.000	MARB BondCo Plc 'REGS'	3,95 %	29.01.2031	764.020	0,08
2.020.000	Prudential Plc	3,13 %	14.04.2030	1.851.247	0,19
1.550.000	Prudential Plc 'EMTN' (Perpetual)	4,88 %	20.01.2023	1.426.000	0,15
1.346.000	Prudential Plc 'EMTN' FRN		03.11.2033	1.120.545	0,12
900.000	Tullow Oil Plc 'REGS'	7,00 %	01.03.2025	742.500	0,08
3.550.000	Tullow Oil Plc 'REGS'	10,25 %	15.05.2026	3.390.250	0,36
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>				<b>14.836.612</b>	<b>1,56</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 1,29 %)</b>					
750.000	Azul Investments LLP 'REGS'	7,25 %	15.06.2026	520.922	0,05

## L&amp;G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 98,04 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 1,29 %) (Fortsetzung)</b>					
1.050.000	Bimbo Bakeries USA Inc 'REGS'	4,00 %	17.05.2051	855.422	0,09
3.150.000	BOC Aviation USA Corp 'REGS'	1,63 %	29.04.2024	3.017.795	0,32
650.000	Braskem America Finance Co 'REGS'	7,13 %	22.07.2041	608.481	0,06
950.000	GUSAP III LP 'REGS'	4,25 %	21.01.2030	861.116	0,09
2.100.000	HCL America Inc 'REGS'	1,38 %	10.03.2026	1.889.738	0,20
1.000.000	Hikma Finance USA LLC	3,25 %	09.07.2025	943.625	0,10
750.000	Kosmos Energy Ltd 'REGS'	7,13 %	04.04.2026	631.312	0,07
500.000	MercadoLibre Inc	3,13 %	14.01.2031	360.094	0,04
700.000	NBM US Holdings Inc 'REGS'	7,00 %	14.05.2026	706.387	0,07
1.400.000	Periama Holdings LLC/DE	5,95 %	19.04.2026	1.246.000	0,13
2.127.000	Playtika Holding Corp 'REGS'	4,25 %	15.03.2029	1.770.727	0,19
1.661.000	SierraCol Energy Andina LLC 'REGS'	6,00 %	15.06.2028	1.218.551	0,13
1.100.000	SK Battery America Inc	2,13 %	26.01.2026	983.884	0,10
800.000	Stillwater Mining Co 'REGS'	4,00 %	16.11.2026	664.000	0,07
1.100.000	Stillwater Mining Co 'REGS'	4,50 %	16.11.2029	863.500	0,09
1.450.000	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC	6,15 %	01.02.2036	1.204.406	0,13
2.639.000	TSMC Arizona Corp	1,75 %	25.10.2026	2.418.248	0,25
1.733.000	TSMC Arizona Corp	3,88 %	22.04.2027	1.726.467	0,18
922.000	TSMC Arizona Corp	4,13 %	22.04.2029	918.261	0,10
2.050.000	TSMC Arizona Corp	2,50 %	25.10.2031	1.761.667	0,18
2.500.000	TSMC Arizona Corp	4,25 %	22.04.2032	2.461.475	0,26
1.900.000	TSMC Arizona Corp	3,13 %	25.10.2041	1.558.893	0,16
1.250.000	TSMC Arizona Corp	3,25 %	25.10.2051	1.006.662	0,11
2.500.000	TSMC Arizona Corp	4,50 %	22.04.2052	2.451.800	0,26
1.850.000	Wipro IT Services LLC 'REGS'	1,50 %	23.06.2026	1.649.391	0,17
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>				<b>34.298.824</b>	<b>3,60</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>937.925.050</b>	<b>98,40</b>

## L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 0,56 %)</b>					
<b>Korea, Republik (Südkorea) (30. Juni 2021: 0,56 %)</b>					
1.150.000	Industrial Bank of Korea 'REGS'	0,63 %	17.09.2024	1.080.678	0,11
1.550.000	Industrial Bank of Korea 'REGS'	1,04 %	22.06.2025	1.431.285	0,15
1.000.000	Korea Expressway Corp 'REGS'	3,63 %	18.05.2025	997.688	0,10
1.022.000	Korea Expressway Corp 'REGS'	1,13 %	17.05.2026	923.827	0,10
1.200.000	Korea Gas Corp 'REGS'	3,88 %	12.02.2024	1.207.350	0,13
1.400.000	Korea Gas Corp 'REGS'	3,50 %	21.07.2025	1.387.137	0,15
1.550.000	Korea Gas Corp 'REGS'	3,50 %	02.07.2026	1.528.978	0,16
1.200.000	Korea Gas Corp 'REGS'	2,88 %	16.07.2029	1.121.100	0,12
1.900.000	Korea Gas Corp 'REGS'	6,25 %	20.01.2042	2.389.013	0,25
950.000	Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd 'REGS'	1,25 %	27.04.2026	863.920	0,09
<b>Korea, Republik (Südkorea) insgesamt</b>				<b>12.930.976</b>	<b>1,36</b>
<b>Staatsanleihe insgesamt</b>				<b>12.930.976</b>	<b>1,36</b>

<b>Gesamtanlagen</b>				
Unternehmensanleihen			937.925.050	98,40
Staatsanleihe			12.930.976	1,36

Anzahl der Kontrakte	Käufe	Verkäufe	Fälligkeit	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettover- mögens
<b>Devisenterminkontrakte<sup>1</sup></b>					
1	59.844 USD	(49.142) GBP	02.08.2022	133	0,00
1	4.085.264 USD	(3.907.270) EUR	01.07.2022	398	0,00
1	828.515 EUR	(863.307) USD	01.07.2022	2.867	0,00
3	5.585.568 USD	(5.326.569) CHF	02.08.2022	11.397	0,00
2	2.545.554 USD	(2.414.602) EUR	02.08.2022	16.208	0,00
1	5.514.942 USD	(4.505.432) GBP	01.07.2022	43.320	0,01
2	390.764.697 CHF	(407.867.861) USD	01.07.2022	306.729	0,03
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten (30. Juni 2021: – %)</b>				<b>381.052</b>	<b>0,04</b>

## L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Anzahl der Kontrakte	Käufe	Verkäufe	Fälligkeit	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<b>Devisenterminkontrakte<sup>1</sup></b>					
1	8.012 USD	(7.691) EUR	01.07.2022	(29)	(0,00)
2	885.286 CHF	(925.024) USD	01.07.2022	(295)	(0,00)
1	93.377 USD	(77.324) GBP	01.07.2022	(530)	(0,00)
1	4.505.432 GBP	(5.518.077) USD	02.08.2022	(43.605)	(0,00)
1	4.582.756 GBP	(5.771.194) USD	01.07.2022	(205.665)	(0,02)
2	5.943.824 USD	(5.902.610) CHF	01.07.2022	(221.767)	(0,02)
4	398.299.668 CHF	(417.467.625) USD	02.08.2022	(653.357)	(0,07)
2	177.100.777 EUR	(187.753.223) USD	02.08.2022	(2.236.514)	(0,24)
2	180.181.226 EUR	(193.096.572) USD	01.07.2022	(4.725.643)	(0,50)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten (30. Juni 2021: – %)</b>				<b>(8.087.405)</b>	<b>(0,85)</b>
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				10.032.873	1,05
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>953.182.546</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					<b>% des Gesamtvermögens</b>
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					97,23
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente					0,04
Sonstige Vermögenswerte					2,73
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

<sup>1</sup> 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 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,94 %)</b>			
<b>Kanada (30. Juni 2021: 6,54 %)</b>			
2.828.672	Ballard Power Systems Inc	17.820.634	3,59
1.509.628	Xebec Adsorption Inc	971.336	0,19
	<b>Kanada insgesamt</b>	<b>18.791.970</b>	<b>3,78</b>
<b>China (30. Juni 2021: 3,11 %)</b>			
16.725.183	Weichai Power Co Ltd 'H'	26.557.492	5,35
	<b>China insgesamt</b>	<b>26.557.492</b>	<b>5,35</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 2,98 %)</b>			
211.620	Orsted AS '144A'	22.071.320	4,44
	<b>Dänemark insgesamt</b>	<b>22.071.320</b>	<b>4,44</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 5,36 %)</b>			
143.149	Air Liquide SA	19.173.861	3,86
454.141	McPhy Energy SA	6.081.969	1,22
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>25.255.830</b>	<b>5,08</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 11,46 %)</b>			
174.471	SFC Energy AG	4.368.508	0,88
1.216.808	Siemens Energy AG	17.790.529	3,58
950.541	Uniper SE	14.081.374	2,83
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>36.240.411</b>	<b>7,29</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 3,01 %)</b>			
72.167	Linde Plc	20.668.754	4,16
	<b>Irland insgesamt</b>	<b>20.668.754</b>	<b>4,16</b>
<b>Japan (30. Juni 2021: 9,83 %)</b>			
418.112	Kyocera Corp	22.331.315	4,49

## L&amp;G Hydrogen Economy UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,94 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 9,83 %) (Fortsetzung)</b>			
1.200.729	Nippon Sanso Holdings Corp	19.117.271	3,85
1.269.012	Toyota Motor Corp	19.615.953	3,95
<b>Japan insgesamt</b>		<b>61.064.539</b>	<b>12,29</b>
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 3,05 %)</b>			
16.076.264	NEL ASA	19.469.470	3,92
<b>Norwegen insgesamt</b>		<b>19.469.470</b>	<b>3,92</b>
<b>Südkorea (30. Juni 2021: 11,01 %)</b>			
720.039	Doosan Fuel Cell Co Ltd	16.664.488	3,35
154.255	Hyundai Motor Co	21.444.105	4,32
408.544	Kolon Industries Inc	16.424.827	3,30
<b>Südkorea insgesamt</b>		<b>54.533.420</b>	<b>10,97</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 7,48 %)</b>			
1.265.098	PowerCell Sweden AB	16.740.574	3,37
<b>Schweden insgesamt</b>		<b>16.740.574</b>	<b>3,37</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 12,96 %)</b>			
11.406.572	AFC Energy Plc	2.853.659	0,57
2.585.744	Ceres Power Holdings Plc	17.208.607	3,46
5.916.635	ITM Power Plc	12.416.470	2,50
778.872	Johnson Matthey Plc	18.213.326	3,67
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>50.692.062</b>	<b>10,20</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 23,15 %)</b>			
93.771	Air Products & Chemicals Inc	22.550.050	4,54
1.461.424	Bloom Energy Corp	24.113.496	4,85

## L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,94 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 23,15 %) (Fortsetzung)</b>			
552.023	Chemours Co/The	17.675.777	3,56
109.589	Cummins Inc	21.208.759	4,27
5.641.067	FuelCell Energy Inc	21.154.001	4,26
5.975.768	Hyzon Motors Inc	17.568.758	3,53
1.136.833	Plug Power Inc	18.837.323	3,79
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>143.108.164</b>	<b>28,80</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>495.194.006</b>	<b>99,65</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		495.194.006	99,65
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.732.944	0,35
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>496.926.950</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,61
Sonstige Vermögenswerte			0,39
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

## L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 65,95 %)</b>					
<b>Belgien (30. Juni 2021: 0,43 %)</b>					
100.000	KBC Group NV 'EMTN' FRN		16.06.2027	90.437	1,11
<b>Belgien insgesamt</b>				<b>90.437</b>	<b>1,11</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 0,18 %)</b>					
40.000	Brookfield Finance Inc	2,72 %	15.04.2031	32.367	0,40
40.000	Canadian Imperial Bank of Commerce	0,95 %	23.10.2025	34.626	0,42
<b>Kanada insgesamt</b>				<b>66.993</b>	<b>0,82</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 2,51 %)</b>					
70.000	Fibria Overseas Finance Ltd	5,50 %	17.01.2027	66.388	0,82
240.000	MTR Corp CI Ltd	2,50 %	02.11.2026	220.185	2,70
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>				<b>286.573</b>	<b>3,52</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 5,25 %)</b>					
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	0,25 %	29.06.2028	86.122	1,06
100.000	Covivio	1,88 %	20.05.2026	96.042	1,18
100.000	Engie SA 'EMTN'	2,13 %	30.03.2032	90.613	1,11
100.000	Gecina SA 'EMTN'	0,88 %	25.01.2033	74.660	0,92
<b>Frankreich insgesamt</b>				<b>347.437</b>	<b>4,27</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 8,37 %)</b>					
50.000	Mercedes-Benz Group AG 'EMTN'	0,75 %	10.09.2030	41.815	0,51
50.000	E.ON SE 'EMTN'	0,38 %	29.09.2027	44.114	0,54
50.000	E.ON SE 'EMTN'	0,35 %	28.02.2030	40.599	0,50
50.000	E.ON SE 'EMTN'	0,60 %	01.10.2032	38.344	0,47
100.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG FRN		05.08.2079	78.426	0,96
45.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	1,00 %	01.10.2026	39.458	0,48
30.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	1,75 %	14.09.2029	26.146	0,32
20.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	0,75 %	30.09.2030	15.872	0,20
23.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN'	0,88 %	15.09.2026	25.061	0,31
90.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN'	0,01 %	05.05.2027	83.539	1,03
80.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN'	0,00 %	15.09.2028	72.123	0,89

## L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 65,95 %)</b> <b>(Fortsetzung)</b>					
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 8,37 %)</b> <b>(Fortsetzung)</b>					
50.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN'	0,00 %	15.06.2029	44.111	0,54
70.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN'	0,00 %	15.09.2031	58.383	0,72
50.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 'EMTN'	0,00 %	22.09.2027	45.815	0,56
100.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN		26.05.2041	76.788	0,94
<b>Deutschland insgesamt</b>				<b>730.594</b>	<b>8,97</b>
<b>International (30. Juni 2021: 8,69 %)</b>					
30.000	Asian Development Bank	0,00 %	24.10.2029	26.011	0,32
20.000	Asian Development Bank 'GMTN'	3,13 %	26.09.2028	19.007	0,23
25.000	European Investment Bank	2,38 %	24.05.2027	23.090	0,28
85.000	European Investment Bank	0,75 %	23.09.2030	67.485	0,83
40.000	European Investment Bank	1,50 %	15.11.2047	33.439	0,41
10.000	European Investment Bank 'EMTN'	0,50 %	15.11.2023	9.954	0,12
13.000	European Investment Bank 'EMTN'	0,75 %	15.11.2024	14.545	0,18
20.000	European Investment Bank 'EMTN'	0,38 %	15.05.2026	19.198	0,24
60.000	European Investment Bank 'EMTN'	1,25 %	13.11.2026	59.244	0,73
40.000	European Investment Bank 'EMTN'	0,50 %	13.11.2037	30.149	0,37
20.000	International Bank for Reconstruction & Development	0,63 %	22.11.2027	18.851	0,23
5.000	International Finance Corp 'GMTN'	2,13 %	07.04.2026	4.612	0,06
60.000	Nordic Investment Bank	0,00 %	25.09.2026	56.160	0,69
15.000	Nordic Investment Bank 'EMTN'	0,13 %	10.06.2024	14.693	0,18
<b>International insgesamt</b>				<b>396.438</b>	<b>4,87</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 1,09 %)</b>					
100.000	AIB Group Plc 'EMTN' FRN		30.05.2031	90.737	1,11
<b>Irland insgesamt</b>				<b>90.737</b>	<b>1,11</b>
<b>Italien (30. Juni 2021: 3,20 %)</b>					
100.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 'EMTN'	1,13 %	09.07.2026	93.856	1,15
100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN'	0,75 %	04.12.2024	95.977	1,18
<b>Italien insgesamt</b>				<b>189.833</b>	<b>2,33</b>

## L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 65,95 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Luxemburg (30. Juni 2021: 1,03 %)</b>					
100.000	CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund	0,90 %	12.10.2029	79.238	0,97
100.000	CPI Property Group SA 'EMTN'	2,75 %	12.05.2026	89.057	1,10
<b>Luxemburg insgesamt</b>				<b>168.295</b>	<b>2,07</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 11,35 %)</b>					
100.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	0,88 %	22.04.2025	97.065	1,19
100.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	0,50 %	23.09.2029	80.999	0,99
100.000	CTP NV 'EMTN'	0,50 %	21.06.2025	85.272	1,05
100.000	CTP NV 'EMTN'	1,25 %	21.06.2029	69.913	0,86
100.000	de Volksbank NV 'EMTN'	0,38 %	03.03.2028	82.621	1,01
100.000	Enel Finance International NV 'EMTN'	1,13 %	16.09.2026	93.930	1,15
194.000	Greenko Dutch BV 'REGS'	3,85 %	29.03.2026	158.659	1,95
100.000	Iberdrola International BV FRN (Perpetual)		22.02.2023	98.159	1,20
100.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN		07.12.2028	97.347	1,20
100.000	Royal Schiphol Group NV 'EMTN'	1,50 %	05.11.2030	91.187	1,12
100.000	TenneT Holding BV 'EMTN'	1,38 %	26.06.2029	91.784	1,13
100.000	TenneT Holding BV 'EMTN'	1,50 %	03.06.2039	74.578	0,92
150.000	TenneT Holding BV FRN (Perpetual)		01.03.2024	144.769	1,78
100.000	VZ Vendor Financing II BV 'REGS'	2,88 %	15.01.2029	74.473	0,91
<b>Niederlande insgesamt</b>				<b>1.340.756</b>	<b>16,46</b>
<b>Portugal (30. Juni 2021: 0,93 %)</b>					
100.000	EDP - Energias de Portugal SA 'EMTN'	1,63 %	15.04.2027	94.660	1,16
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN		02.08.2081	81.067	1,00
<b>Portugal insgesamt</b>				<b>175.727</b>	<b>2,16</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: 3,11 %)</b>					
100.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,13 %	23.06.2027	90.192	1,11
100.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN		18.11.2026	90.276	1,11
<b>Spanien insgesamt</b>				<b>180.468</b>	<b>2,22</b>

## L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 65,95 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 2,27 %)</b>					
100.000	Ellaktor Value Plc 'REGS'	6,38 %	15.12.2024	96.176	1,18
100.000	National Grid Plc 'EMTN'	0,25 %	01.09.2028	82.411	1,01
100.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	1,75 %	30.09.2034	90.336	1,11
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>				<b>268.923</b>	<b>3,30</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 10,15 %)</b>					
20.000	Alexandria Real Estate Equities Inc	2,00 %	18.05.2032	15.162	0,19
15.000	Apple Inc	2,85 %	23.02.2023	14.356	0,18
20.000	AvalonBay Communities Inc	2,05 %	15.01.2032	15.843	0,19
50.000	Avangrid Inc	3,20 %	15.04.2025	46.566	0,57
50.000	Boston Properties LP	4,50 %	01.12.2028	46.578	0,57
45.000	Citigroup Inc FRN		15.05.2024	42.197	0,52
80.000	Clearway Energy Operating LLC '144A'	4,75 %	15.03.2028	69.635	0,86
50.000	Dana Inc	4,25 %	01.09.2030	36.826	0,45
100.000	Digital Euro Finco LLC	2,50 %	16.01.2026	96.324	1,18
10.000	Duke Energy Carolinas LLC	3,95 %	15.11.2028	9.446	0,12
10.000	Duke Realty LP	2,88 %	15.11.2029	8.611	0,11
60.000	Equinix Inc	1,00 %	15.09.2025	51.731	0,64
60.000	Fifth Third Bancorp FRN		01.11.2027	50.866	0,63
80.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A'	3,75 %	15.09.2030	61.791	0,76
40.000	Interstate Power and Light Co	4,10 %	26.09.2028	37.834	0,46
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN		16.09.2024	45.861	0,56
20.000	Kaiser Foundation Hospitals	3,15 %	01.05.2027	18.632	0,23
20.000	Kilroy Realty LP	4,75 %	15.12.2028	18.833	0,23
10.000	Massachusetts Institute of Technology	3,96 %	01.07.2038	9.887	0,12
30.000	MidAmerican Energy Co	3,65 %	15.04.2029	27.937	0,34
50.000	MidAmerican Energy Co	4,25 %	15.07.2049	44.847	0,55
30.000	Niagara Mohawk Power Corp '144A'	1,96 %	27.06.2030	23.745	0,29
40.000	Northern States Power Co/MN	2,90 %	01.03.2050	28.844	0,35
50.000	Owens Corning	3,95 %	15.08.2029	44.497	0,55

## L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2021: 65,95 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 10,15 %) (Fortsetzung)</b>					
50.000	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A'	4,50 %	15.08.2028	41.848	0,51
24.000	PNC Financial Services Group Inc/The	2,20 %	01.11.2024	22.235	0,27
10.000	Prologis LP	1,25 %	15.10.2030	7.627	0,09
40.000	Union Electric Co	2,63 %	15.03.2051	26.800	0,33
40.000	Verizon Communications Inc	3,88 %	08.02.2029	37.140	0,46
20.000	Verizon Communications Inc	2,85 %	03.09.2041	14.433	0,18
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>				<b>1.016.932</b>	<b>12,49</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>				<b>5.350.143</b>	<b>65,70</b>
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 33,21 %)</b>					
<b>Belgien (30. Juni 2021: 2,88 %)</b>					
167.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A'	1,25 %	22.04.2033	154.922	1,90
<b>Belgien insgesamt</b>				<b>154.922</b>	<b>1,90</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 15,67 %)</b>					
486.000	French Republic Government Bond OAT '144A'	1,75 %	25.06.2039	452.130	5,55
236.000	French Republic Government Bond OAT '144A'	0,50 %	25.06.2044	159.769	1,96
100.000	SNCF Reseau 'EMTN'	0,75 %	25.05.2036	79.788	0,98
100.000	Societe Du Grand Paris EPIC 'EMTN'	0,00 %	25.11.2030	84.551	1,04
100.000	Societe Du Grand Paris EPIC 'EMTN'	1,70 %	25.05.2050	80.029	0,99
<b>Frankreich insgesamt</b>				<b>856.267</b>	<b>10,52</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 4,66 %)</b>					
38.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2030	34.429	0,42
128.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2031	113.733	1,40
160.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2050	102.531	1,26
<b>Deutschland insgesamt</b>				<b>250.693</b>	<b>3,08</b>

## L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 33,21 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Hongkong (30. Juni 2021: 0,71 %)</b>					
100.000	Hong Kong Government International Bond 'GMTN'	0,00 %	24.11.2026	90.500	1,11
200.000	Hong Kong Government International Bond 'REGS'	1,38 %	02.02.2031	163.802	2,01
<b>Hongkong insgesamt</b>				<b>254.302</b>	<b>3,12</b>
<b>Ungarn (30. Juni 2021: 0,41 %)</b>					
40.000	Hungary Government International Bond	1,75 %	05.06.2035	28.329	0,35
<b>Ungarn insgesamt</b>				<b>28.329</b>	<b>0,35</b>
<b>International (30. Juni 2021: – %)</b>					
10.000	European Investment Bank	1,00 %	14.11.2042	7.731	0,10
240.000	European Union	0,40 %	04.02.2037	182.997	2,25
80.000	European Union	1,25 %	04.02.2043	64.721	0,79
<b>International insgesamt</b>				<b>255.449</b>	<b>3,14</b>
<b>Irland (30. Juni 2021: 1,81 %)</b>					
109.000	Ireland Government Bond	1,35 %	18.03.2031	105.126	1,29
<b>Irland insgesamt</b>				<b>105.126</b>	<b>1,29</b>
<b>Italien (30. Juni 2021: – %)</b>					
216.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A'	1,50 %	30.04.2045	148.185	1,82
<b>Italien insgesamt</b>				<b>148.185</b>	<b>1,82</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 2,99 %)</b>					
251.000	Netherlands Government Bond '144A'	0,50 %	15.01.2040	196.409	2,41
<b>Niederlande insgesamt</b>				<b>196.409</b>	<b>2,41</b>
<b>Polen (30. Juni 2021: 0,72 %)</b>					
40.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN'	1,00 %	07.03.2029	35.635	0,44
30.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN'	2,00 %	08.03.2049	23.312	0,28
<b>Polen insgesamt</b>				<b>58.947</b>	<b>0,72</b>

## L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihe (30. Juni 2021: 33,21 %) (Fortsetzung)</b>					
<b>Spanien (30. Juni 2021: 0,72 %)</b>					
100.000	Adif Alta Velocidad 'EMTN'	1,25 %	04.05.2026	98.357	1,21
40.000	Instituto de Credito Oficial 'EMTN'	0,00 %	30.04.2027	36.767	0,45
93.000	Spain Government Bond '144A'	1,00 %	30.07.2042	66.255	0,81
<b>Spanien insgesamt</b>				<b>201.379</b>	<b>2,47</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: – %)</b>					
165.000	United Kingdom Gilt	0,88 %	31.07.2033	163.855	2,01
100.000	United Kingdom Gilt	1,50 %	31.07.2053	90.027	1,11
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>				<b>253.882</b>	<b>3,12</b>
<b>Staatsanleihe insgesamt</b>				<b>2.763.890</b>	<b>33,94</b>
<b>Gesamtanlagen</b>					
Unternehmensanleihen				5.350.143	65,70
Staatsanleihe				2.763.890	33,94
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten* Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen				29.567	0,36
				<b>8.143.600</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					36,03
Sonstige Vermögenswerte					63,97
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW- Vorschriften vorgeschrieben.					

\*In den sonstigen Vermögenswerten sind Anteile am LGIM Euro Liquidity Fund mit einem Wert von 42.118 € enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

## L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,30 %)</b>			
<b>Gibraltar (30. Juni 2021: 0,92 %)</b>			
142.366	888 Holdings Plc	238.605	0,56
<b>Gibraltar insgesamt</b>		<b>238.605</b>	<b>0,56</b>
<b>Israel (30. Juni 2021: 1,20 %)</b>			
41.823	Plus500 Ltd	699.699	1,62
<b>Israel insgesamt</b>		<b>699.699</b>	<b>1,62</b>
<b>Jersey (30. Juni 2021: 5,80 %)</b>			
564.301	Man Group Plc/Jersey	1.409.624	3,27
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>1.409.624</b>	<b>3,27</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 91,38 %)</b>			
72.452	Admiral Group Plc	1.625.823	3,77
57.082	Anglo American Plc	1.676.498	3,89
203.575	Ashmore Group Plc	451.529	1,05
22.579	AstraZeneca Plc	2.438.532	5,66
290.565	BAE Systems Plc	2.412.271	5,60
124.760	Brewin Dolphin Holdings Plc	638.771	1,48
62.688	British American Tobacco Plc	2.206.304	5,12
58.713	Chesnara Plc	164.690	0,38
6.701	City of London Investment Group Plc	28.747	0,07
53.112	Devro Plc	97.407	0,22
59.301	Diageo Plc	2.093.622	4,86
156.621	Ferrexpo Plc	204.077	0,47
15.640	Games Workshop Group Plc	1.044.752	2,42
137.389	GlaxoSmithKline Plc	2.425.740	5,63
183.330	IG Group Holdings Plc	1.265.894	2,94
123.144	Imperial Brands Plc	2.260.924	5,24
135.286	Intermediate Capital Group Plc	1.770.894	4,11
190.039	Jupiter Fund Management Plc	281.448	0,65

## L&amp;G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,30 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 91,38 %) (Fortsetzung)</b>			
29.837	Keller Group Plc	216.020	0,50
819.385	Legal & General Group Plc	1.962.427	4,55
4.562.199	Lloyds Banking Group Plc	1.930.266	4,48
217.173	Moneysupermarket.com Group Plc	378.098	0,88
194.495	National Grid Plc	2.046.087	4,75
106.002	Paragon Banking Group Plc	518.774	1,20
96.720	Persimmon Plc	1.801.894	4,18
25.514	Rathbones Group Plc	495.482	1,15
41.138	Record Plc	28.797	0,07
35.206	Rio Tinto Plc	1.730.903	4,01
1.414	S&U Plc	28.704	0,07
78.473	Severn Trent Plc	2.133.681	4,95
166.847	Tate & Lyle Plc	1.250.351	2,90
26.664	Telecom Plus Plc	521.548	1,21
207.094	United Utilities Group Plc	2.112.359	4,90
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>40.243.314</b>	<b>93,36</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>42.591.242</b>	<b>98,81</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	42.591.242	98,81
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	514.374	1,19
		<b>43.105.616</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		98,79
	Sonstige Vermögenswerte		1,21
			<b>100,00</b>
	Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

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

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,24 %)</b>			
<b>Österreich (30. Juni 2021: 3,04 %)</b>			
365	Agrana Beteiligungs AG	6.205	0,03
4.632	ANDRITZ AG	178.054	0,84
10.886	Erste Group Bank AG	263.441	1,24
1.964	Oesterreichische Post AG	53.421	0,25
7.082	OMV AG	316.990	1,49
833	Strabag SE	33.778	0,16
6.425	UNIQA Insurance Group AG	43.305	0,20
	<b>Österreich insgesamt</b>	<b>895.194</b>	<b>4,21</b>
<b>Belgien (30. Juni 2021: 1,77 %)</b>			
6.745	Ageas SA/NV	283.155	1,33
6.351	Econocom Group SA/NV	21.212	0,10
4.910	KBC Group NV	262.882	1,24
	<b>Belgien insgesamt</b>	<b>567.249</b>	<b>2,67</b>
<b>Dänemark (30. Juni 2021: 1,75 %)</b>			
4.233	Spar Nord Bank A/S	42.748	0,20
3.338	Sydbank AS	97.492	0,46
15.049	Tryg A/S	322.464	1,51
	<b>Dänemark insgesamt</b>	<b>462.704</b>	<b>2,17</b>
<b>Finnland (30. Juni 2021: 11,10 %)</b>			
5.730	Elisa Oyj	307.243	1,44
16.921	Fortum Oyj	242.224	1,14
5.320	Kemira Oyj	62.031	0,29
9.675	Nokian Renkaat Oyj	100.910	0,47
29.461	Nordea Bank Abp	247.354	1,16
6.528	Orion Oyj	278.093	1,31
5.134	Raisio Oyj	9.960	0,05

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

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,24 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Finnland (30. Juni 2021: 11,10 %) (Fortsetzung)</b>			
7.200	Sampo Oyj - Class A	298.944	1,40
4.845	TietoEVRY Oyj	114.148	0,54
9.675	UPM-Kymmene Oyj	280.672	1,32
<b>Finnland insgesamt</b>		<b>1.941.579</b>	<b>9,12</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 16,06 %)</b>			
2.249	Air Liquide SA	288.142	1,35
12.141	AXA SA	262.974	1,23
5.990	BNP Paribas SA	271.736	1,28
9.727	Bouygues SA	285.585	1,34
10.060	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	261.309	1,23
24.863	Credit Agricole SA	217.079	1,02
128	Euroapi SA	1.927	0,01
11.838	Eutelsat Communications SA	127.140	0,60
1.627	Gaztransport Et Technigaz SA	194.427	0,91
2.156	Imerys SA	62.653	0,29
22.197	Orange SA	249.050	1,17
5.214	Publicis Groupe SA	243.285	1,14
5.960	Rubis SCA	132.789	0,62
3.063	Sanofi	295.089	1,39
2.199	Schneider Electric SE	248.267	1,17
9.318	SCOR SE	191.019	0,90
12.173	Societe Generale SA	254.294	1,19
5.521	TotalEnergies SE	278.093	1,31
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>3.864.858</b>	<b>18,15</b>
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 12,88 %)</b>			
1.442	Allianz SE	262.617	1,23
1.723	Hannover Rueck SE	238.636	1,12
1.118	HOCHTIEF AG	51.931	0,25

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

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,24 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: 12,88 %) (Fortsetzung)</b>			
1.265	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	283.613	1,33
2.460	Siemens AG	238.842	1,12
1.952	Takkt AG	29.280	0,14
3.356	Talanx AG	121.890	0,57
37.795	Telefonica Deutschland Holding AG	103.558	0,49
1.498	Wuestenrot & Wuerttembergische AG	25.286	0,12
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>1.355.653</b>	<b>6,37</b>
<b>Italien (30. Juni 2021: 11,17 %)</b>			
100.098	A2A SpA	121.319	0,57
2.255	ACEA SpA	31.818	0,15
16.347	Assicurazioni Generali SpA	248.883	1,17
5.932	Azimut Holding SpA	98.382	0,46
3.251	Banca Generali SpA	87.647	0,41
1.498	Banca IFIS SpA	20.238	0,10
10.993	Banca Mediolanum SpA	69.014	0,32
46.916	Enel SpA	244.901	1,15
140.792	Intesa Sanpaolo SpA	250.610	1,18
37.437	Iren SpA	78.019	0,37
30.472	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	251.638	1,18
12.583	Piaggio & C SpA	28.110	0,13
5.508	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	228.637	1,07
38.888	Terna - Rete Elettrica Nazionale	291.193	1,37
27.038	Unipol Gruppo SpA	117.237	0,55
22.647	UnipolSai Assicurazioni SpA	51.726	0,24
	<b>Italien insgesamt</b>	<b>2.219.372</b>	<b>10,42</b>
<b>Liechtenstein (30. Juni 2021: 0,03 %)</b>			
171	VP Bank AG	15.343	0,07
	<b>Liechtenstein insgesamt</b>	<b>15.343</b>	<b>0,07</b>

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

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,24 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 5,36 %)</b>			
30.432	ING Groep NV	287.004	1,35
1.746	Koninklijke DSM NV	239.377	1,12
5.341	Randstad NV	246.754	1,16
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>773.135</b>	<b>3,63</b>
<b>Norwegen (30. Juni 2021: 6,00 %)</b>			
4.275	Atea ASA	42.383	0,20
15.844	DNB Bank ASA	270.822	1,27
9.224	Gjensidige Forsikring ASA	178.161	0,84
14.142	Leroy Seafood Group ASA	95.775	0,45
11.986	Mowi ASA	260.057	1,22
7.920	SpareBank 1 SMN	88.794	0,42
10.006	SpareBank 1 SR-Bank ASA	103.366	0,48
19.920	Telenor ASA	252.646	1,19
6.590	TGS ASA	88.239	0,41
5.967	Veidekke ASA	51.705	0,24
6.670	Yara International ASA	265.799	1,25
<b>Norwegen insgesamt</b>		<b>1.697.747</b>	<b>7,97</b>
<b>Polen (30. Juni 2021: 1,48 %)</b>			
3.094	Asseco Poland SA	49.700	0,23
15.898	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	231.764	1,09
1.312	Warsaw Stock Exchange	10.484	0,05
<b>Polen insgesamt</b>		<b>291.948</b>	<b>1,37</b>
<b>Portugal (30. Juni 2021: 1,85 %)</b>			
4.111	Altri SGPS SA	26.187	0,12
68.973	EDP - Energias de Portugal SA	307.068	1,44
13.624	Navigator Co SA/The	52.262	0,24
9.802	NOS SGPS SA	37.600	0,18

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

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,24 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Portugal (30. Juni 2021: 1,85 %) (Fortsetzung)</b>			
21.446	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	61.657	0,29
59.257	Sonae SGPS SA	69.390	0,33
	<b>Portugal insgesamt</b>	<b>554.164</b>	<b>2,60</b>
<b>Spanien (30. Juni 2021: 7,34 %)</b>			
5.171	Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	17.033	0,08
41.072	Bankinter SA	244.461	1,15
4.428	Ebro Foods SA	71.291	0,34
14.625	Enagas SA	308.149	1,45
31.355	Iberdrola SA	310.289	1,46
58.627	Mapfre SA	98.611	0,46
7.817	Mediaset Espana Comunicacion SA	30.658	0,14
10.443	Prosegur Cia de Seguridad SA	17.586	0,08
17.734	Red Electrica Corp SA	319.655	1,50
	<b>Spanien insgesamt</b>	<b>1.417.733</b>	<b>6,66</b>
<b>Schweden (30. Juni 2021: 7,91 %)</b>			
26.124	Atlas Copco AB	233.047	1,09
4.138	Bilia AB	56.895	0,27
6.936	Boliden AB	210.641	0,99
2.148	Clas Ohlson AB	21.213	0,10
15.151	Electrolux AB	194.684	0,91
4.307	Intrum AB	78.456	0,37
4.208	Loomis AB - Class B	97.726	0,46
6.537	Nobia AB	16.719	0,08
11.401	Peab AB	63.639	0,30
15.671	Sandvik AB	242.602	1,14
30.207	Skandinaviska Enskilda Banken AB - Class A	283.089	1,33
584	Skandinaviska Enskilda Banken AB - Class C	6.193	0,03
34.314	Svenska Handelsbanken AB - Class A	280.004	1,31

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

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,24 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (30. Juni 2021: 7,91 %) (Fortsetzung)</b>			
2.937	Svenska Handelsbanken AB - Class B	27.579	0,13
<b>Schweden insgesamt</b>		<b>1.812.487</b>	<b>8,51</b>
<b>Schweiz (30. Juni 2021: 11,50 %)</b>			
7.239	Adecco Group AG	234.631	1,10
61	APG SGA SA	10.727	0,05
1.857	Baloise Holding AG	289.257	1,36
1.554	Banque Cantonale Vaudoise	116.295	0,55
1.630	Cembra Money Bank AG	111.070	0,52
4.496	EFG International AG	31.535	0,15
2.072	Helvetia Holding AG	231.243	1,09
6.823	Holcim AG	278.480	1,31
810	Roche Holding AG	257.804	1,21
62	Schweiter Technologies AG	56.124	0,26
529	Swiss Life Holding AG	245.773	1,15
558	Swisscom AG	294.036	1,38
19.053	UBS Group AG	292.973	1,38
792	Valiant Holding AG	66.392	0,31
660	Zurich Insurance Group AG	273.796	1,28
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>2.790.136</b>	<b>13,10</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>20.659.302</b>	<b>97,02</b>
<b>Vorzugsaktien (3. Juni 2021: – %)</b>			
<b>Deutschland (30. Juni 2021: – %)</b>			
3.892	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	263.099	1,24
3.850	FUCHS PETROLUB SE - Preference	102.410	0,48
3.340	Porsche Automobil Holding SE - Preference	210.821	0,99
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>576.330</b>	<b>2,71</b>
<b>Vorzugsaktien Insgesamt</b>		<b>576.330</b>	<b>2,71</b>

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

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Gesamtanlagen	Wert €	% des Gesamt- vermö- gens
Stammaktien	20.659.302	97,02
Vorzugsaktien	576.330	2,71
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	58.273	0,27
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>21.293.905</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,70
Sonstige Vermögenswerte		0,30
		<b>100,00</b>
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 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,49 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 31,93 %)</b>			
46.223	Accent Group Ltd	39.415	0,19
246.640	Alumina Ltd	248.472	1,18
49.839	APA Group	386.251	1,83
6.295	ASX Ltd	353.710	1,68
79.644	Atlas Arteria Ltd	441.433	2,10
145.164	Aurizon Holdings Ltd	379.332	1,80
32.292	Australian Finance Group Ltd	33.531	0,16
8.181	Brickworks Ltd	104.302	0,49
99.590	Centuria Capital Group	123.957	0,59
29.216	Fortescue Metals Group Ltd	352.192	1,67
20.220	GUD Holdings Ltd	111.098	0,53
81.256	Harvey Norman Holdings Ltd	207.303	0,98
22.218	IPH Ltd	124.673	0,59
25.225	IRESS Ltd	199.656	0,95
10.522	JB Hi-Fi Ltd	278.281	1,32
2.902	Macquarie Group Ltd	328.297	1,56
20.631	Magellan Financial Group Ltd	183.299	0,87
157.106	Medibank Pvt Ltd	351.118	1,67
126.693	Metcash Ltd	369.399	1,75
11.329	Mineral Resources Ltd	376.050	1,78
95.610	Mount Gibson Iron Ltd	35.504	0,17
119.638	Orora Ltd	300.288	1,43
10.976	Premier Investments Ltd	145.446	0,69
4.317	Rio Tinto Ltd	304.880	1,45
75.521	Service Stream Ltd	45.441	0,22
12.279	SmartGroup Corp Ltd	51.592	0,24
14.653	Sonic Healthcare Ltd	332.620	1,58
22.159	Super Retail Group Ltd	129.370	0,61

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 31,93 %) (Fortsetzung)</b>			
28.771	Tassal Group Ltd	94.769	0,45
<b>Australien insgesamt</b>		<b>6.431.679</b>	<b>30,53</b>
<b>Bermuda (30. Juni 2021: 5,37 %)</b>			
55.000	CK Infrastructure Holdings Ltd	337.137	1,60
48.000	Luk Fook Holdings International Ltd	123.258	0,59
214.400	Man Wah Holdings Ltd	231.696	1,10
300.989	Pou Sheng International Holdings Ltd	34.138	0,16
22.004	VTech Holdings Ltd	173.015	0,82
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>899.244</b>	<b>4,27</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 12,35 %)</b>			
66.500	Asia Cement China Holdings Corp	36.441	0,17
52.508	CK Hutchison Holdings Ltd	354.984	1,69
203.000	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	87.182	0,41
91.000	SITC International Holdings Co Ltd	257.450	1,22
44.723	Texhong Textile Group Ltd	47.305	0,23
168.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	287.744	1,37
160.000	Towngas Smart Energy Co Ltd	85.230	0,40
158.000	Uni-President China Holdings Ltd	135.510	0,64
134.118	Value Partners Group Ltd	50.591	0,24
92.000	VSTECS Holdings Ltd	73.629	0,35
353.000	Want Want China Holdings Ltd	306.801	1,46
497.000	WH Group Ltd '144A'	383.820	1,82
143.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	342.968	1,63
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>2.449.655</b>	<b>11,63</b>
<b>Hongkong (30. Juni 2021: 7,64 %)</b>			
102.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	402.958	1,91
198.000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	65.605	0,31

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Hongkong (30. Juni 2021: 7,64 %) (Fortsetzung)</b>			
359.330	Guotai Junan International Holdings Ltd	42.587	0,20
19.900	Hang Seng Bank Ltd	351.238	1,67
341.447	Lenovo Group Ltd	318.952	1,51
516.000	PCCW Ltd	272.895	1,30
58.000	Power Assets Holdings Ltd	364.765	1,73
<b>Hongkong insgesamt</b>		<b>1.819.000</b>	<b>8,63</b>
<b>Neuseeland (30. Juni 2021: 9,41 %)</b>			
60.125	Chorus Ltd	269.900	1,28
68.274	Contact Energy Ltd	309.028	1,47
14.203	EBOS Group Ltd	344.482	1,63
65.082	Genesis Energy Ltd	107.230	0,51
56.074	Heartland Group Holdings Ltd	66.241	0,31
110.410	Meridian Energy Ltd	321.266	1,52
16.904	Scales Corp Ltd	45.613	0,22
117.658	Spark New Zealand Ltd	351.135	1,67
33.422	Vector Ltd	86.652	0,41
<b>Neuseeland insgesamt</b>		<b>1.901.547</b>	<b>9,02</b>
<b>Singapur (30. Juni 2021: 6,58 %)</b>			
14.111	DBS Group Holdings Ltd	300.937	1,43
93.829	Olam Group Ltd	102.479	0,48
41.400	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	338.827	1,61
73.821	Riverstone Holdings Ltd	39.252	0,18
129.200	Singapore Technologies Engineering Ltd	378.771	1,80
15.600	United Overseas Bank Ltd	294.245	1,40
28.874	Venture Corp Ltd	345.028	1,64
<b>Singapur insgesamt</b>		<b>1.799.539</b>	<b>8,54</b>

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,49 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Südkorea (30. Juni 2021: 26,21 %)</b>			
40.463	BNK Financial Group Inc	209.109	0,99
6.218	DB Insurance Co Ltd	293.564	1,39
21.992	DGB Financial Group Inc	128.896	0,61
9.438	Hana Financial Group Inc	286.033	1,36
8.250	Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	196.655	0,93
33.521	Industrial Bank of Korea	248.361	1,18
7.665	KB Financial Group Inc	284.250	1,35
2.872	KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd	84.939	0,40
11.194	Korean Reinsurance Co	72.420	0,34
5.590	KT&G Corp	353.895	1,68
2.549	Kumho Petrochemical Co Ltd	272.883	1,30
8.215	Meritz Fire & Marine Insurance Co Ltd	209.741	1,00
38.167	Meritz Securities Co Ltd	133.455	0,63
20.499	NH Investment & Securities Co Ltd	142.880	0,68
272	Samchully Co Ltd	37.708	0,18
4.209	Samsung Card Co Ltd	98.871	0,47
2.413	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	373.547	1,77
7.362	Samsung Life Insurance Co Ltd	354.945	1,69
8.868	Samsung Securities Co Ltd	228.462	1,08
11.689	Shinhan Financial Group Co Ltd	333.547	1,58
7.500	SK Telecom Co Ltd	300.370	1,43
2.849	TKG Huchems Co Ltd	43.336	0,21
	<b>Südkorea insgesamt</b>	<b>4.687.867</b>	<b>22,25</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>19.988.531</b>	<b>94,87</b>
<b>Vorzugsaktien (3. Juni 2021: – %)</b>			
<b>Südkorea (30. Juni 2021: – %)</b>			
1.334	Amorepacific Corp - Preference	52.193	0,25

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Vorzugsaktien (3. Juni 2021: – %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Südkorea (30. Juni 2021: – %) (Fortsetzung)</b>			
5.130	Hyundai Motor Co - Preference	346.109	1,64
3.102	Hyundai Motor Co - Preference	207.851	0,99
1.065	LG Chem Ltd - Preference	197.268	0,94
2.346	LG Electronics Inc - Preference	76.700	0,36
275	LG H&H Co Ltd - Preference	69.152	0,33
349	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd - Preference	42.335	0,20
<b>Südkorea insgesamt</b>		<b>991.608</b>	<b>4,71</b>
<b>Vorzugsaktien Insgesamt</b>		<b>991.608</b>	<b>4,71</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		19.988.531	94,87
Vorzugsaktien		991.608	4,71
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		89.597	0,42
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>21.069.736</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,54
Sonstige Vermögenswerte			0,46
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

## L&amp;G Digital Payments UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,86 %)</b>			
<b>Australien (30. Juni 2021: 5,00 %)</b>			
279.296	EML Payments Ltd	236.236	2,03
<b>Australien insgesamt</b>		<b>236.236</b>	<b>2,03</b>
<b>Kanada (30. Juni 2021: 7,85 %)</b>			
13.351	Lightspeed Commerce Inc	297.042	2,56
6.443	Nuvei Corp '144A'	232.354	2,01
8.810	Shopify Inc - Class A	275.224	2,37
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>804.620</b>	<b>6,94</b>
<b>Cayman-Inseln (30. Juni 2021: 9,26 %)</b>			
12.016	Dlocal Ltd/Uruguay - Class A	315.420	2,72
21.153	Pagseguro Digital Ltd - Class A	216.607	1,87
31.683	StoneCo Ltd - Class A	243.959	2,11
6.549	Tencent Holdings Ltd	295.779	2,55
112.864	Yeahka Ltd	319.305	2,75
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>1.391.070</b>	<b>12,00</b>
<b>Zypern (30. Juni 2021: 2,20 %)</b>			
43.235	QIWI plc ADR*	-	-
<b>Zypern insgesamt</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Frankreich (30. Juni 2021: 4,62 %)</b>			
5.847	Edenred	274.891	2,37
7.168	Worldline SA/France '144A'	265.131	2,29
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>540.022</b>	<b>4,66</b>
<b>Italien (30. Juni 2021: 2,53 %)</b>			
29.291	Nexi SpA '144A'	242.039	2,09
<b>Italien insgesamt</b>		<b>242.039</b>	<b>2,09</b>

## L&amp;G Digital Payments UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (30. Juni 2021: 4,75 %)</b>			
23.902	Credit Saison Co Ltd	274.287	2,37
3.536	GMO Payment Gateway Inc	248.565	2,14
<b>Japan insgesamt</b>		<b>522.852</b>	<b>4,51</b>
<b>Niederlande (30. Juni 2021: 2,42 %)</b>			
194	Adyen NV '144A'	281.511	2,43
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>281.511</b>	<b>2,43</b>
<b>Neuseeland (30. Juni 2021: 2,26 %)</b>			
313.552	Pushpay Holdings Ltd	247.585	2,13
<b>Neuseeland insgesamt</b>		<b>247.585</b>	<b>2,13</b>
<b>Vereinigtes Königreich (30. Juni 2021: 2,04 %)</b>			
104.588	Network International Holdings Plc '144A'	239.808	2,07
64.892	Wise Plc - Class A	234.375	2,02
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>474.183</b>	<b>4,09</b>
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 52,19 %)</b>			
11.198	ACI Worldwide Inc	289.916	2,50
1.838	American Express Co	254.784	2,20
3.722	Block Inc	228.754	1,97
62.060	BTRS Holdings Inc	309.059	2,67
4.407	Coupa Software Inc	251.640	2,17
2.704	Discover Financial Services	255.744	2,21
2.506	Euronet Worldwide Inc	252.079	2,17
12.439	Evo Payments Inc - Class A	292.565	2,52
732	Fair Isaac Corp	293.459	2,53
2.846	Fidelity National Information Services Inc	260.893	2,25
2.952	Fiserv Inc	262.639	2,27
16.137	Flywire Corp	284.495	2,45

## L&amp;G Digital Payments UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2021: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (30. Juni 2021: 52,19 %) (Fortsetzung)</b>			
2.329	Global Payments Inc	257.681	2,22
10.269	Green Dot Corp - Class A	257.855	2,22
12.565	I3 Verticals Inc - Class A	314.376	2,71
14.724	International Money Express Inc	301.400	2,60
30.468	Marqeta Inc	247.095	2,13
840	Mastercard Inc	265.003	2,29
22.797	OneSpan Inc	271.284	2,34
50.192	Paya Holdings Inc	329.761	2,84
3.638	PayPal Holdings Inc	254.078	2,19
5.621	Q2 Holdings Inc	216.802	1,87
22.341	Repay Holdings Corp - Class A	287.082	2,48
1.412	Visa Inc - Class A	278.009	2,40
31.543	Zuora Inc	282.310	2,44
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>6.798.763</b>	<b>58,64</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>11.538.881</b>	<b>99,52</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	11.538.881	99,52
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	55.478	0,48
		<b>11.594.359</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,48
	Sonstige Vermögenswerte		0,52
			<b>100,00</b>
	Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

\*Dieses Wertpapier wird mit null bewertet.

## L&amp;G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF\*

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					
795.902.955	Barclays Bank Plc	1,69 %	22.07.2022	795.902.955	94,89
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>795.902.955</b>	<b>94,89</b>

Nominal- wert	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens	
<b>Swap-Kontrakte</b>				
896.929.999	Barclays Backwardation Tilt Multi-Strategy Capped Total Return Index <sup>1</sup>	21.07.2022	(57.878.638)	(6,90)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten</b>			<b>(57.878.638)</b>	<b>(6,90)</b>

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente</b>			
80.360.375	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund	80.360.375	9,58
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>		<b>80.360.375</b>	<b>9,58</b>

<b>Gesamtanlagen</b>			
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	795.902.955	94,89
	Geldmarktinstrumente	80.360.375	9,58
	Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten	(57.878.638)	(6,90)
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	20.377.892	2,43
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>838.762.584</b>	<b>100,00</b>

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			% des Gesamt- vermö- gens
	Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden		8,96
	Einlagen bei Kreditinstituten		88,70
	Sonstige Vermögenswerte		2,34
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

\* Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien</b>			
<b>Bermuda</b>			
42.000	China Water Affairs Group Ltd	39.072	0,25
68.000	Kunlun Energy Co Ltd	55.721	0,35
68.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	57.541	0,36
47.862	Shenzhen International Holdings Ltd	47.088	0,30
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>199.422</b>	<b>1,26</b>
<b>Brasilien</b>			
24.700	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	51.767	0,33
11.374	Banco do Brasil SA	72.601	0,46
11.600	Banco Santander Brasil SA	63.907	0,40
7.600	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	61.286	0,39
7.100	Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	15.641	0,10
10.500	Cia de Saneamento do Parana (Units)	36.623	0,23
3.800	Direcional Engenharia SA	7.492	0,05
7.100	Energisa SA	54.783	0,34
7.400	Engie Brasil Energia SA	58.442	0,37
20.557	Itau Unibanco Holding SA	76.773	0,48
14.070	Klabin SA	54.349	0,34
17.500	MRV Engenharia e Participacoes SA	26.136	0,16
11.135	Odontoprev SA	19.909	0,13
8.200	Porto Seguro SA	27.848	0,18
7.300	Sao Martinho SA	50.714	0,32
8.600	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA (Units)	63.512	0,40
<b>Brasilien insgesamt</b>		<b>741.783</b>	<b>4,68</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
6.000	Bizlink Holding Inc	62.253	0,39
124.000	Bosideng International Holdings Ltd	76.957	0,49

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Cayman-Inseln (Fortsetzung)</b>			
195.000	China Dongxiang Group Co Ltd	11.058	0,07
42.000	China Hongqiao Group Ltd	47.476	0,30
45.000	China Lesso Group Holdings Ltd	67.899	0,43
10.000	China Lilang Ltd	4.970	0,03
36.000	China Medical System Holdings Ltd	56.154	0,35
82.048	China Resources Cement Holdings Ltd	55.103	0,35
44.000	China State Construction International Holdings Ltd	48.671	0,31
50.713	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	47.954	0,30
66.400	China Zhongwang Holdings Ltd**	–	–
28.000	CIMC Enric Holdings Ltd	30.080	0,19
17.000	Consun Pharmaceutical Group Ltd	9.056	0,06
79.000	Fufeng Group Ltd	50.640	0,32
63.000	Greatview Aseptic Packaging Co Ltd	12.605	0,08
12.500	Hengan International Group Co Ltd	58.701	0,37
15.000	Kingboard Holdings Ltd	56.774	0,36
38.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	47.494	0,30
113.000	Lonking Holdings Ltd	27.361	0,17
25.000	TCL Electronics Holdings Ltd	11.820	0,07
25.500	Tian Lun Gas Holdings Ltd	16.021	0,10
30.000	Tianneng Power International Ltd	32.458	0,21
38.500	Xtep International Holdings Ltd	69.670	0,44
20.343	Zhen Ding Technology Holding Ltd	70.470	0,44
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>971.645</b>	<b>6,13</b>
<b>Chile</b>			
463.218	Banco de Chile	41.285	0,26
1.351.826	Banco Santander Chile	53.460	0,34
3.508	CAP SA	30.966	0,19
<b>Chile insgesamt</b>		<b>125.711</b>	<b>0,79</b>

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>China</b>			
172.500	Agricultural Bank of China Ltd 'A'	77.705	0,49
127.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H'	47.906	0,30
91.130	Angang Steel Co Ltd 'H'	34.027	0,21
10.900	Anhui Conch Cement Co Ltd 'A'	57.360	0,36
10.500	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	45.495	0,29
1.100	Anhui Expressway Co Ltd 'A'	1.226	0,01
26.000	Anhui Expressway Co Ltd 'H'	21.007	0,13
66.400	Bank of Beijing Co Ltd 'A'	44.965	0,28
141.100	Bank of China Ltd 'A'	68.611	0,43
119.000	Bank of China Ltd 'H'	47.467	0,30
29.000	Bank of Chongqing Co Ltd 'H'	15.448	0,10
76.700	Bank of Communications Co Ltd 'A'	56.974	0,36
107.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	73.906	0,47
31.400	Bank of Nanjing Co Ltd 'A'	48.803	0,31
49.000	Baoshan Iron & Steel Co Ltd 'A'	43.999	0,28
22.200	BBMG Corp 'A'	9.172	0,06
119.000	BBMG Corp 'H'	17.288	0,11
74.000	Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H'	16.975	0,11
28.500	China CITIC Bank Corp Ltd 'A'	20.192	0,13
117.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	52.335	0,33
128.000	China Communications Services Corp Ltd 'H'	56.276	0,35
24.300	China Construction Bank Corp 'A'	21.965	0,14
84.000	China Construction Bank Corp 'H'	56.414	0,36
111.317	China Datang Corp Renewable Power Co Ltd 'H'	37.877	0,24
135.000	China Everbright Bank Co Ltd 'A'	60.611	0,38
126.101	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	40.818	0,26
44.323	China Life Insurance Co Ltd 'H'	77.157	0,49

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
19.751	China Merchants Securities Co Ltd 'H' '144A'	21.445	0,14
101.600	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A'	56.375	0,36
162.000	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H'	57.806	0,36
52.000	China National Building Material Co Ltd 'H'	55.532	0,35
15.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'A'	52.646	0,33
25.800	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	63.062	0,40
103.000	China Railway Group Ltd 'H'	63.661	0,40
85.500	China State Construction Engineering Corp Ltd 'A'	67.847	0,43
89.533	China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H'	45.640	0,29
19.000	China Yangtze Power Co Ltd 'A'	65.523	0,41
4.300	Chinese Universe Publishing and Media Group Co Ltd 'A'	6.407	0,04
70.850	Chongqing Changan Automobile Co Ltd	35.123	0,22
9.100	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'A'	5.022	0,03
118.000	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'H'	42.406	0,27
29.000	CITIC Securities Co Ltd 'H'	64.822	0,41
132.193	CRRC Corp Ltd 'H'	49.191	0,31
70.589	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	53.614	0,34
7.000	Fangda Special Steel Technology Co Ltd 'A'	7.298	0,05
3.300	Gansu Qilianshan Cement Group Co Ltd 'A'	6.104	0,04
40.400	GF Securities Co Ltd 'H'	53.441	0,34
72.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	69.642	0,44
88.754	Haitong Securities Co Ltd 'H'	65.149	0,41
10.900	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd 'A'	47.637	0,30
11.200	Hengyi Petrochemical Co Ltd 'A'	17.558	0,11
6.800	Huaibei Mining Holdings Co Ltd 'A'	14.768	0,09
38.400	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	56.962	0,36
51.800	Huaxia Bank Co Ltd 'A'	40.255	0,25

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
5.600	Huaxin Cement Co Ltd 'A'	16.297	0,10
11.500	Huaxin Cement Co Ltd 'H'	16.619	0,10
11.200	Huayu Automotive Systems Co Ltd 'A'	38.423	0,24
72.300	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A'	51.441	0,32
117.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	69.482	0,44
20.300	Industrial Bank Co Ltd 'A'	60.256	0,38
4.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'A'	5.113	0,03
64.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	64.433	0,41
10.200	Kingfa Sci & Tech Co Ltd 'A'	14.484	0,09
11.100	Lao Feng Xiang Co Ltd 'A'	36.253	0,23
7.200	Livzon Pharmaceutical Group Inc 'H'	24.912	0,16
240.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	73.404	0,46
56.000	PICC Property & Casualty Co Ltd 'H'	58.234	0,37
10.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	69.643	0,44
6.634	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	45.103	0,28
22.600	SAIC Motor Corp Ltd 'A'	60.038	0,38
23.500	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'H'	8.954	0,06
35.700	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H'	59.144	0,37
55.300	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd 'A'	66.071	0,42
21.100	Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd 'A'	17.153	0,11
36.000	Shenzhen Expressway Corp Ltd 'H'	37.390	0,24
29.700	Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd 'A'	28.751	0,18
58.000	Sichuan Expressway Co Ltd 'H'	14.635	0,09
151.750	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H'	25.914	0,16
29.600	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	71.746	0,45
94.000	Sinotrans Ltd 'H'	26.953	0,17
29.000	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H'	24.355	0,15
6.000	Weifu High-Technology Group Co Ltd	11.355	0,07
3.000	Weifu High-Technology Group Co Ltd 'A'	8.614	0,05

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
9.300	Xiamen C & D Inc 'A'	18.130	0,11
8.300	Xinjiang Tianshan Cement Co Ltd 'A'	15.228	0,10
66.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	60.895	0,38
20.100	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	18.496	0,12
83.200	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	44.426	0,28
	<b>China insgesamt</b>	<b>3.599.260</b>	<b>22,70</b>
<b>Kolumbien</b>			
9.455	Interconexion Electrica SA ESP	46.581	0,29
	<b>Kolumbien insgesamt</b>	<b>46.581</b>	<b>0,29</b>
<b>Tschechische Republik</b>			
25	Philip Morris CR AS	17.202	0,11
	<b>Tschechische Republik insgesamt</b>	<b>17.202</b>	<b>0,11</b>
<b>Ägypten</b>			
21.301	Commercial International Bank Egypt SAE	42.240	0,27
43.870	Eastern Co SAE	24.035	0,15
24.055	Egypt Kuwait Holding Co SAE	30.742	0,19
36.395	Egyptian Financial Group-Hermes Holding Co	23.095	0,15
9.547	Oriental Weavers	3.357	0,02
	<b>Ägypten insgesamt</b>	<b>123.469</b>	<b>0,78</b>
<b>Griechenland</b>			
2.169	Hellenic Petroleum Holdings SA	14.218	0,09
	<b>Griechenland insgesamt</b>	<b>14.218</b>	<b>0,09</b>

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Hongkong</b>			
17.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	60.444	0,38
58.000	CITIC Ltd	58.761	0,37
11.000	CPMC Holdings Ltd	4.766	0,03
73.000	Far East Horizon Ltd	61.213	0,39
57.000	Fosun International Ltd	52.664	0,33
46.000	Guangdong Investment Ltd	48.656	0,31
154.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	63.979	0,40
30.500	Sinotruk Hong Kong Ltd	42.755	0,27
	<b>Hongkong insgesamt</b>	<b>393.238</b>	<b>2,48</b>
<b>Ungarn</b>			
10.088	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	77.559	0,49
	<b>Ungarn insgesamt</b>	<b>77.559</b>	<b>0,49</b>
<b>Indien</b>			
1.275	Bajaj Auto Ltd	59.843	0,38
7.370	Bajaj Consumer Care Ltd	12.911	0,08
14.161	Bharat Petroleum Corp Ltd	55.301	0,35
1.233	Care Ratings Ltd	6.554	0,04
21.500	Castrol India Ltd	28.123	0,18
12.194	Engineers India Ltd	8.801	0,06
33.331	GAIL India Ltd	57.062	0,36
19.022	Hindustan Petroleum Corp Ltd	52.317	0,33
66.489	Indian Oil Corp Ltd	62.513	0,39
20.834	Indus Towers Ltd	55.163	0,35
21.351	ITC Ltd	73.944	0,47
122.235	NHPC Ltd (Units)	47.595	0,30
32.829	NMDC Ltd	44.979	0,28
23.121	Petronet LNG Ltd	63.620	0,40
45.247	Power Finance Corp Ltd	59.844	0,38
22.976	Power Grid Corp of India Ltd	61.650	0,39

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Indien (Fortsetzung)</b>			
10.643	PTC India Ltd	10.249	0,06
38.476	REC Ltd	60.292	0,38
4.509	Sun TV Network Ltd	23.555	0,15
5.742	Welspun Corp Ltd	15.912	0,10
	<b>Indien insgesamt</b>	<b>860.228</b>	<b>5,43</b>
<b>Indonesien</b>			
122.200	Bank Mandiri Persero Tbk PT	65.007	0,41
103.200	Bank Pembangunan Daerah Jawa Barat Dan Banten Tbk PT	9.525	0,06
21.500	Gudang Garam Tbk PT	44.992	0,29
225.200	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	60.466	0,38
244.500	Unilever Indonesia Tbk PT	78.286	0,49
37.400	United Tractors Tbk PT	71.298	0,45
	<b>Indonesien insgesamt</b>	<b>329.574</b>	<b>2,08</b>
<b>Jersey</b>			
108.000	West China Cement Ltd	13.626	0,09
	<b>Jersey insgesamt</b>	<b>13.626</b>	<b>0,09</b>
<b>Kuwait</b>			
71.674	Ahli United Bank BSC	62.358	0,39
	<b>Kuwait insgesamt</b>	<b>62.358</b>	<b>0,39</b>
<b>Malaysia</b>			
55.100	Astro Malaysia Holdings Bhd	11.314	0,07
24.200	Bursa Malaysia Bhd	36.403	0,23
61.400	Hartalega Holdings Bhd	42.628	0,27
13.700	Hong Leong Bank Bhd	63.596	0,40

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Malaysia (Fortsetzung)</b>			
66.500	Kossan Rubber Industries Bhd	19.916	0,13
13.600	Petronas Dagangan Bhd	65.169	0,41
15.300	Petronas Gas Bhd	57.069	0,36
47.700	RHB Bank Bhd	62.013	0,39
13.100	Syarikat Takaful Malaysia Keluarga Bhd	9.600	0,06
28.100	Tenaga Nasional Bhd	50.876	0,32
128.900	Top Glove Corp Bhd	30.415	0,19
<b>Malaysia insgesamt</b>		<b>448.999</b>	<b>2,83</b>
<b>Mexiko</b>			
96.900	Alfa SAB de CV	68.584	0,43
12.800	Alpek SAB de CV	17.631	0,11
21.000	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	37.148	0,24
11.255	Coca-Cola Femsa SAB de CV (Units)	62.111	0,39
4.700	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	65.248	0,41
10.100	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	56.152	0,35
45.300	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	61.139	0,39
23.400	Orbia Advance Corp SAB de CV	54.581	0,35
<b>Mexiko insgesamt</b>		<b>422.594</b>	<b>2,67</b>
<b>Pakistan</b>			
63.395	Bank Alfalah Ltd	9.914	0,06
23.401	MCB Bank Ltd	14.064	0,09
29.044	Oil & Gas Development Co Ltd	11.166	0,07
6.142	Pakistan Oilfields Ltd	12.181	0,08
15.709	Pakistan State Oil Co Ltd	13.192	0,08
13.794	United Bank Ltd/Pakistan	7.626	0,05
<b>Pakistan insgesamt</b>		<b>68.143</b>	<b>0,43</b>

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Panama</b>			
242.990	BAC Holding International Corp	15.942	0,10
	<b>Panama insgesamt</b>	<b>15.942</b>	<b>0,10</b>
<b>Philippinen</b>			
124.429	LT Group Inc	18.330	0,12
50.700	Manila Water Co Inc	15.417	0,10
28.400	Universal Robina Corp	57.332	0,36
	<b>Philippinen insgesamt</b>	<b>91.079</b>	<b>0,58</b>
<b>Katar</b>			
48.160	Masraf Al Rayan QSC	54.617	0,35
13.633	Qatar Electricity & Water Co QSC	65.587	0,41
22.956	Qatar International Islamic Bank QSC	67.196	0,42
	<b>Katar insgesamt</b>	<b>187.400</b>	<b>1,18</b>
<b>Russland</b>			
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**	-	-

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Russland (Fortsetzung)</b>			
128.500	Sistema PJSFC**	–	–
13.280	Tatneft PJSC**	–	–
387.000	Unipro PJSC**	–	–
95.730.000	VTB Bank PJSC**	–	–
<b>Russland insgesamt</b>		<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Saudi-Arabien</b>			
3.958	Advanced Petrochemical Co	54.220	0,34
2.476	Arabian Cement Co/Saudi Arabia	22.238	0,14
4.005	Banque Saudi Fransi	50.595	0,32
1.152	Jarir Marketing Co	49.923	0,31
6.670	Riyad Bank	57.063	0,36
2.189	Saudi Telecom Co	56.649	0,36
1.792	United International Transportation Co	21.492	0,14
3.713	Yanbu National Petrochemical Co	49.973	0,31
<b>Saudi-Arabien insgesamt</b>		<b>362.153</b>	<b>2,28</b>
<b>Südafrika</b>			
3.584	African Rainbow Minerals Ltd	46.762	0,29
1.315	Astral Foods Ltd	15.122	0,10
15.636	AVI Ltd	62.725	0,40
3.328	Clicks Group Ltd	55.521	0,35
3.786	JSE Ltd	23.233	0,15
1.488	Kumba Iron Ore Ltd	47.744	0,30
16.388	Pick n Pay Stores Ltd	56.229	0,35
25.714	Sanlam Ltd	82.985	0,52
6.087	SPAR Group Ltd/The	51.319	0,32
6.669	Vodacom Group Ltd	53.380	0,34
<b>Südafrika insgesamt</b>		<b>495.020</b>	<b>3,12</b>

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Taiwan</b>			
7.000	Accton Technology Corp	56.149	0,35
3.000	Advantech Co Ltd	34.910	0,22
9.000	Arcadyan Technology Corp	36.323	0,23
27.000	Asia Cement Corp	39.773	0,25
12.000	Asia Vital Components Co Ltd	37.574	0,24
4.851	Asustek Computer Inc	50.658	0,32
4.000	Aten International Co Ltd	10.305	0,06
84.000	AUO Corp	46.049	0,29
13.000	Catcher Technology Co Ltd	72.359	0,46
30.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	51.356	0,32
23.000	Chicony Electronics Co Ltd	57.319	0,36
24.700	China General Plastics Corp	25.420	0,16
28.000	Chipbond Technology Corp	55.843	0,35
9.000	Chroma ATE Inc	46.311	0,29
38.000	Compeq Manufacturing Co Ltd	55.466	0,35
73.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	61.624	0,39
3.000	Cub Elecparts Inc	13.167	0,08
9.000	Darfon Electronics Corp	12.244	0,08
7.000	Delta Electronics Inc	52.147	0,33
13.000	E Ink Holdings Inc	82.415	0,52
12.000	Elan Microelectronics Corp	56.300	0,36
7.000	Elite Material Co Ltd	42.023	0,27
29.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	81.538	0,51
9.000	Feng TAY Enterprise Co Ltd	53.122	0,34
81.000	First Financial Holding Co Ltd	71.374	0,45
15.000	FLEXium Interconnect Inc	43.688	0,28
20.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	50.246	0,32
17.000	Formosa Plastics Corp	62.034	0,39
26.686	Foxconn Technology Co Ltd	44.247	0,28
24.800	Fubon Financial Holding Co Ltd	49.878	0,31

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Taiwan (Fortsetzung)</b>			
16.000	Getac Holdings Corp	21.713	0,14
13.000	Gigabyte Technology Co Ltd	38.781	0,24
44.798	Goldsun Building Materials Co Ltd	34.352	0,22
5.000	Grape King Bio Ltd	22.449	0,14
13.762	Greatek Electronics Inc	28.882	0,18
9.000	Holtek Semiconductor Inc	25.971	0,16
3.000	Holy Stone Enterprise Co Ltd	10.039	0,06
16.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	58.654	0,37
8.515	Hsin Kuang Steel Co Ltd	11.355	0,07
4.000	Hu Lane Associate Inc	16.951	0,11
114.000	Innolux Corp	46.392	0,29
2.400	International Games System Co Ltd	60.215	0,38
71.000	Inventec Corp	60.055	0,38
14.321	ITEQ Corp	34.582	0,22
39.000	King Yuan Electronics Co Ltd	52.466	0,33
36.833	King's Town Bank Co Ltd	43.853	0,28
5.000	Kinik Co	24.551	0,15
30.000	Lite-On Technology Corp	58.419	0,37
2.000	Machvision Inc	9.316	0,06
8.000	Makalot Industrial Co Ltd	37.937	0,24
1.474	MediaTek Inc	32.273	0,20
53.000	Mega Financial Holding Co Ltd	62.922	0,40
6.787	Merry Electronics Co Ltd	17.553	0,11
12.000	Micro-Star International Co Ltd	45.807	0,29
2.000	Nan Liu Enterprise Co Ltd	5.778	0,04
19.000	Nan Ya Plastics Corp	53.038	0,33
16.000	Nantex Industry Co Ltd	22.897	0,14
4.000	Novatek Microelectronics Corp	40.628	0,26
7.000	Pixart Imaging Inc	22.766	0,14

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Taiwan (Fortsetzung)</b>			
22.000	Powertech Technology Inc	64.964	0,41
4.090	Poya International Co Ltd	43.467	0,27
15.000	Primax Electronics Ltd	31.177	0,20
57.625	Qisda Corp	55.525	0,35
18.619	Quanta Computer Inc	49.970	0,32
18.000	Radiant Opto-Electronics Corp	52.547	0,33
4.000	Realtek Semiconductor Corp	48.834	0,31
14.000	Sercomm Corp	38.186	0,24
7.000	Shin Zu Shing Co Ltd	19.234	0,12
21.159	Sigurd Microelectronics Corp	36.933	0,23
6.000	Simplo Technology Co Ltd	51.356	0,32
7.000	Sinbon Electronics Co Ltd	59.798	0,38
10.000	Sino-American Silicon Products Inc	47.421	0,30
96.000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	54.242	0,34
4.472	Sitronix Technology Corp	30.081	0,19
3.000	Sporton International Inc	17.657	0,11
2.000	St Shine Optical Co Ltd	17.691	0,11
8.000	Sunonwealth Electric Machine Industry Co Ltd	8.960	0,06
3.000	Swancor Holding Co Ltd	12.208	0,08
4.000	TaiDoc Technology Corp	26.031	0,16
5.000	Taiflex Scientific Co Ltd	7.492	0,05
37.000	Taiwan Cement Corp	49.153	0,31
11.581	Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd	29.640	0,19
11.000	Taiwan Paiho Ltd	25.453	0,16
11.000	Taiwan Union Technology Corp	20.680	0,13
69.000	Teco Electric and Machinery Co Ltd	69.270	0,44
27.000	Tong Yang Industry Co Ltd	44.813	0,28
7.000	Topco Scientific Co Ltd	32.489	0,20
3.000	Topkey Corp	12.965	0,08

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Taiwan (Fortsetzung)</b>			
16.000	Tripod Technology Corp	60.000	0,38
12.000	TTY Biopharm Co Ltd	28.977	0,18
13.000	TXC Corp	39.656	0,25
28.000	Uni-President Enterprises Corp	63.094	0,40
7.000	United Integrated Services Co Ltd	34.725	0,22
38.073	United Microelectronics Corp	50.131	0,32
13.000	Vanguard International Semiconductor Corp	33.578	0,21
13.000	Wistron NeWeb Corp	30.255	0,19
36.000	WPG Holdings Ltd	66.713	0,42
66.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	43.728	0,28
	<b>Taiwan insgesamt</b>	<b>3.961.551</b>	<b>24,98</b>
<b>Thailand</b>			
4.900	Delta Electronics Thailand PCL	46.152	0,29
11.600	Electricity Generating PCL	57.910	0,37
26.900	Hana Microelectronics PCL	31.005	0,20
25.500	Kiatnakin Phatra Bank PCL	44.718	0,28
42.088	PTT Global Chemical PCL	54.165	0,34
54.600	PTT PCL	52.507	0,33
59.200	Ratchthani Leasing PCL	6.731	0,04
17.000	SCB X PCL	50.007	0,32
4.800	Siam Cement PCL/The	50.776	0,32
46.100	Sri Trang Agro-Industry PCL	27.643	0,17
110.400	Thai Union Group PCL	53.397	0,34
14.300	Thai Vegetable Oil PCL	12.741	0,08
43.100	Thanachart Capital PCL	46.020	0,29
23.700	Tisco Financial Group PCL	59.325	0,37
1.537.000	TMBThanachart Bank PCL	53.472	0,34
55.200	TTW PCL	16.550	0,10
	<b>Thailand insgesamt</b>	<b>663.119</b>	<b>4,18</b>

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Türkei</b>			
2.020	Akcansa Cimento AS	2.582	0,02
10.208	Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	16.605	0,10
9.075	Arcelik AS	39.406	0,25
12.039	BIM Birlesik Magazalar AS	58.297	0,37
3.361	Coca-Cola Icecek AS	26.008	0,16
1.273	Dogus Otomotiv Servis ve Ticaret AS	5.745	0,04
34.963	Enka Insaat ve Sanayi AS	36.101	0,23
34.998	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	56.889	0,36
3.192	Ford Otomotiv Sanayi AS	51.045	0,32
38.566	Haci Omer Sabanci Holding AS	43.679	0,27
244	Otokar Otomotiv Ve Savunma Sanayi A.S.	6.212	0,04
72.955	Petkim Petrokimya Holding AS	38.539	0,24
6.798	Tekfen Holding AS	8.803	0,06
5.995	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	21.543	0,14
386	Turk Traktor ve Ziraat Makineleri AS	5.035	0,03
41.484	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	40.250	0,25
	<b>Türkei insgesamt</b>	<b>456.739</b>	<b>2,88</b>
<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>			
20.157	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	48.621	0,31
27.432	Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	56.013	0,35
101.843	Dubai Investments PJSC	60.721	0,38
36.676	Dubai Islamic Bank PJSC	57.514	0,36
7.664	Emirates Telecommunications Group Co PJSC	54.458	0,34
11.921	First Abu Dhabi Bank PJSC	60.950	0,39
	<b>Vereinigte Arabische Emirate insgesamt</b>	<b>338.277</b>	<b>2,13</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>15.086.890</b>	<b>95,15</b>

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Vorzugsaktien</b>			
<b>Brasilien</b>			
8.700	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA - Preference	14.906	0,09
11.142	Bradespar SA - Preference	53.777	0,34
8.200	Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista - Preference	36.018	0,23
48.300	Cia Paranaense de Energia - Preference	63.083	0,40
13.447	Gerdau SA - Preference	57.471	0,36
16.911	Itau Unibanco Holding SA - Preference	73.310	0,46
33.269	Metalurgica Gerdau SA - Preference	60.756	0,38
12.000	Randon SA Implementos e Participacoes - Preference	21.524	0,14
	<b>Brasilien insgesamt</b>	<b>380.845</b>	<b>2,40</b>
<b>Chile</b>			
18.249	Embotelladora Andina SA - Preference	31.898	0,20
987	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA - Preference	80.594	0,51
	<b>Chile insgesamt</b>	<b>112.492</b>	<b>0,71</b>
<b>Kolumbien</b>			
242.990	Grupo Aval Acciones y Valores SA - Preference	43.797	0,28
	<b>Kolumbien insgesamt</b>	<b>43.797</b>	<b>0,28</b>
<b>Russland</b>			
160.100	Surgutneftegas PJSC - Preference**	–	–
7.493	Tatneft PJSC - Preference**	–	–
41	Transneft PJSC - Preference**	–	–
	<b>Russland insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
	<b>Vorzugsaktien insgesamt</b>	<b>537.134</b>	<b>3,39</b>

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF \*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Gesamt- vermö- gens
Stammaktien	15.086.890	95,15
Vorzugsaktien	537.134	3,39
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	232.353	1,46
	<b>15.856.377</b>	<b>100,00</b>

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	98,50
Sonstige Vermögenswerte	1,50
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

\* Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt

\*\* Diese Wertpapiere werden mit Null bewertet

## L&amp;G India INR Government Bond UCITS ETF\*

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2022

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Staatsanleihe</b>					
<b>Indien</b>					
761.200.000	India Government Bond	7,32 %	28.01.2024	9.749.645	3,49
1.254.500.000	India Government Bond	6,18 %	04.11.2024	15.665.091	5,61
1.450.000.000	India Government Bond	5,22 %	15.06.2025	17.523.569	6,27
1.352.700.000	India Government Bond	5,15 %	09.11.2025	16.160.974	5,79
1.885.500.000	India Government Bond	5,63 %	12.04.2026	22.724.606	8,13
935.000.000	India Government Bond	5,74 %	15.11.2026	11.213.252	4,01
1.536.700.000	India Government Bond	7,26 %	14.01.2029	19.361.379	6,93
1.407.200.000	India Government Bond	6,45 %	07.10.2029	16.859.227	6,03
1.370.400.000	India Government Bond	5,79 %	11.05.2030	15.730.382	5,63
1.543.100.000	India Government Bond	5,77 %	03.08.2030	17.652.177	6,32
1.497.200.000	India Government Bond	5,85 %	01.12.2030	17.085.338	6,12
1.894.500.000	India Government Bond	6,10 %	12.07.2031	21.892.694	7,84
1.113.000.000	India Government Bond	6,54 %	17.01.2032	13.228.877	4,74
1.058.500.000	India Government Bond	7,72 %	15.06.2049	13.340.572	4,78
1.271.000.000	India Government Bond	7,16 %	20.09.2050	15.121.476	5,41
1.864.000.000	India Government Bond	6,67 %	17.12.2050	20.813.261	7,45
1.095.000.000	India Government Bond	6,99 %	15.12.2051	12.691.865	4,54
	<b>Indien insgesamt</b>			<b>276.814.385</b>	<b>99,09</b>
	<b>Staatsanleihe insgesamt</b>			<b>276.814.385</b>	<b>99,09</b>
<b>Gesamtanlagen</b>					
	Staatsanleihe			276.814.385	99,09
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten**			2.552.786	0,91
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>			<b>279.367.171</b>	<b>100,00</b>

**L&G India INR Government Bond UCITS ETF\*****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2022

	% des Gesamt- vermö- gens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	97,16
Sonstige Vermögenswerte	2,84
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

\* Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt

\*\*In den sonstigen Vermögenswerten sind Anteile am L&amp;G Liquidity Funds Plc - LGIM US Dollar Liquidity Fund mit einem Wert von 54.015 US\$ enthalten. Diese sind als „Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente“ in der Bilanz des Fonds ausgewiesen.

## OGAW-V-Vergütungspolitik (ungeprüft)

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Vergütungspolitik im Zusammenhang mit der Verwaltung der Gesellschaft umgesetzt, die mit den in der OGAW-Richtlinie dargelegten Vergütungsregelungen in Einklang steht (die „Vergütungsregelungen“). Die Vergütungspolitik ist mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und fördert dieses. Sie animiert nicht zum Eingehen von Risiken, die mit den Risikoprofilen, Vorschriften oder Satzungen der Gesellschaft und ihrer Fonds unvereinbar sind.

Die Vergütungsregelungen gelten für die Mitarbeiterkategorien, deren berufliche Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil der Gesellschaft auswirkt (die „identifizierten Mitarbeiter“). Zu den identifizierten Mitarbeitern zählen alle Mitarbeiter und anderes Personal, die bzw. das Entscheidungsträger, Fondsmanager und Personen sind/ist, die effektive Anlageentscheidungen treffen, Personen, die in der Lage sind, Einfluss auf diese Mitarbeiter oder dieses Personal auszuüben, u. a. Anlageberater und -analysten, Mitglieder der obersten Führungsspitze und Mitarbeiter, die eine Gesamtvergütung erhalten, durch die sie unter dieselbe Vergütungskategorie wie Mitglieder der obersten Führungsspitze und Entscheidungsträger fallen.

Im Berichtsjahr wurde jedem der unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder (d. h. Herr David Fagan, Herr Feargal Dempsey und Herr Donard McClean) ein festes Honorar von 45.000 €, 45.000 € bzw. 40.000 € in Bezug auf der Gesellschaft erbrachte Dienste gezahlt. Keines der unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder erhält eine variable Vergütung.

Verwaltungsratsmitglieder, die gleichzeitig bei LGIMH beschäftigt sind (nämlich Herr Howie Li und Frau Patrizia Libotte), erhalten von der Gesellschaft oder der Verwaltungsgesellschaft weder eine feste noch eine variable Vergütung.

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

Kein Verwaltungsratsmitglied hatte oder hat Anspruch auf Pensionen von der Gesellschaft oder der Verwaltungsgesellschaft, und weder die Gesellschaft noch die Verwaltungsgesellschaft hat einem Verwaltungsratsmitglied Aktienoptionen oder langfristige Leistungsanreize gewährt.

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 hat sich die Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft nicht auf Bevollmächtigte der Verwaltungsgesellschaft erstreckt. Es gehört jedoch zu den Grundsätzen der Verwaltungsgesellschaft, sicherzustellen, dass die Vergütungsanforderungen, die an die Delegierten gestellt werden, die „ESMA-Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der OGAW-Richtlinie“ erfüllen oder übertreffen.

Die Verwaltungsgesellschaft hat festgelegt, dass im Hinblick auf die Größe, den internen Betrieb, die Art, den Umfang und die Komplexität der Verwaltungsgesellschaft kein Vergütungsausschuss erforderlich ist. Die Verwaltungsgesellschaft überprüft die Umsetzung der Vergütungspolitik jährlich.

Die allgemeinen Grundsätze der Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft und deren Umsetzung wurden vom Risikoüberwachungsausschuss überprüft, einem aus verschiedenen Mitarbeitern der Unternehmensgruppe L&G bestehenden Ausschuss. Diese üben Aufgaben der Risiko-, Innenrevision- und Compliance-Überwachung in Bezug auf das Geschäft der Verwaltungsgesellschaft aus (d. h. es handelt sich nicht um einen Ausschuss des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft).

## Value-at-Risk-Bericht („VaR“-Bericht) (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

Fonds	Tracking-Index	Tatsächlicher Wert	Max. Wert	Wertüberprüfung
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	LevDAX® x2 Index	2,00	2	Erfüllt
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	ShortDAX® x2 Index	2,00	2	Erfüllt
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return	1,00	2	Erfüllt
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	FTSE 100® Daily Leveraged Index	2,00	2	Erfüllt
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index	2,00	2	Erfüllt
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR	1,01	2	Erfüllt
L&G All Commodities UCITS ETF	Bloomberg Commodity Index Total Return	1,00	2	Erfüllt
L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>	Barclays Backwardation Tilt Multi-Strategy Capped Total Return Index	1,00	2	Erfüllt

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

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. 99,70 % bis 99,85 %. Dadurch wird der relative VaR im Zeitablauf knapp unter 2 gebracht, wenn die Daten für ein Jahr herangezogen werden. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 kam es zu keinen Verstößen.

## Weitere Informationen (ungeprüft)

### Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions)

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 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 2022 und per 30. Juni 2021 in US-Dollar wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Australischer Dollar	1,4542	1,3320
Brasilianischer Real	5,2294	n. zutr.
Kanadischer Dollar	1,2900	1,2383
Chilenischer Peso	936,8651	n. zutr.
Chinesischer Yuan	6,7042	n. zutr.
Chinesischer Yuan Renminbi	6,6943	6,4615
Kolumbianischer Peso	4.161,1019	n. zutr.
Tschechische Krone	23,6601	n. zutr.
Dänische Krone	7,1133	6,2705
Ägyptisches Pfund	18,8000	n. zutr.
Euro	0,9565	0,8432
Hongkong Dollar	7,8470	7,7658
Ungarischer Forint	379,5400	n. zutr.
Indische Rupie	78,9725	n. zutr.
Indonesische Rupiah	14.897,5005	n. zutr.
Israelischer Schekel	3,5022	3,2585
Japanischer Yen	135,8550	110,9900
Koreanischer Won	1.298,4001	1126,1500
Kuwaitischer Dinar	0,3069	n. zutr.
Malaysischer Ringgit	4,4075	n. zutr.
Mexikanischer Peso	20,1757	n. zutr.
Neuseeland-Dollar	1,6084	1,4311
Norwegische Krone	9,8797	8,6052
Pakistanische Rupie	204,6250	n. zutr.
Philippinischer Peso	54,9850	n. zutr.
Polnischer Zloty	4,4958	3,8070
Britisches Pfund	0,8234	0,7239
Katar-Riyal	3,6417	n. zutr.
Russischer Rubel	54,7501	n. zutr.
Saudi Riyal	3,7521	n. zutr.
Singapur-Dollar	1,3917	1,3442
Südafrikanischer Rand	16,3825	14,2788
Schwedische Krone	10,2474	8,5522

## Zusätzliche Informationen (ungeprüft) (Fortsetzung)

### Wechselkurse (Fortsetzung)

	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Schweizer Franken	0,9573	0,9244
Taiwanesischer Dollar	29,7335	27,8625
Thailändischer Baht	35,3550	n. zutr.
Türkische Lira	16,6965	n. zutr.
VAE-Dirham	3,6731	n. zutr.

Zur Umrechnung der auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten per 30. Juni 2022 und per 30. Juni 2021 in Euro wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Australischer Dollar	1,5203	1,5796
Dänische Krone	7,4367	7,4362
Hongkong Dollar	8,2036	9,2095
Norwegische Krone	10,3288	10,2048
Polnischer Zloty	4,7002	4,5147
Britisches Pfund	0,8608	0,8584
Schwedische Krone	10,7132	10,1420
Schweizer Franken	1,0009	1,0962
US-Dollar	1,0455	1,1859

Zur Umrechnung der auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten per 30. Juni 2022 und per 30. Juni 2021 in GBP wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Euro	1,1617	1,1649
US-Dollar	1,2145	1,3815

Zur Umrechnung der Erträge und Aufwendungen aus Fremdwährungen zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 wurden die folgenden durchschnittlichen Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2022	30. Juni 2022	30. Juni 2022
	USD	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

	30. Juni 2021	30. Juni 2021	30. Juni 2021
	USD	EUR	GBP
Euro	0,8387	1,0000	1,1290
Britisches Pfund	0,7434	0,8862	1,0000
US-Dollar	1,0000	1,1928	1,3469

## 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 2022 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 2022 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 2022 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 2022 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 79 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 2022 im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) Sachsicherheiten aufgeführt:

Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten		Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF*</b>	€		<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF*</b>	€
Netherlands Government Bond	5.387.658		Republic of Austria Government Bond	7.386.653
Canadian Government Bond	5.383.623		Finland Government Bond	7.373.979
Republic of Austria Government Bond	5.350.602		French Republic Government Bond OAT	7.322.032
French Republic Government Bond OAT	5.269.510		Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.621.380
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	3.952.033		Netherlands Government Bond	5.638.003
Bundesobligation	900.837		Canadian Government Bond	1.967.836
Bundesschatzanweisungen	554.162		Bundesobligation	710.752
United States Treasury Note/Bond	470		United States Treasury Note/Bond	930

\* Wenn zum 30. Juni 2022 weniger als zehn Sicherheitenemittenten vorhanden waren, wurden alle Emittenten berücksichtigt.

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF</b>	<b>\$</b>	<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF*</b>	<b>£</b>
Philip Morris International Inc	31.171.857	Finland Government Bond	3.232.285
Texas Instruments Inc	31.171.856	Netherlands Government Bond	3.230.051
HSBC Holdings Plc	31.171.841	French Republic Government Bond OAT	3.228.410
K+S AG	28.857.058	Republic of Austria Government Bond	3.218.702
Teleperformance	25.056.800	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2.913.456
Thales SA	23.421.698	Bundesschatzanweisungen	276.962
Electricite de France SA	23.178.813	United States Treasury Note/Bond	106.261
Dassault Systemes SE	21.310.951	Bundessobligation	6
Harbour Energy Plc	20.823.959	<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	<b>\$</b>
Wacker Chemie AG	19.574.912	Oxford Nanopore Technologies Plc	1.464.744
<b>L&amp;G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF*</b>	<b>£</b>	Hapag-Lloyd AG	1.464.741
French Republic Government Bond OAT	2.098.142	Antin Infrastructure Partners SA	1.464.738
Bundesschatzanweisungen	2.098.121	Liberty Global Plc	1.464.736
Finland Government Bond	2.088.890	Renewi Plc	1.464.713
Republic of Austria Government Bond	2.000.761	BioMerieux	1.464.699
Canadian Government Bond	1.842.819	Eiffage SA	1.464.672
United States Treasury Note/Bond	275.523	Henry Boot Plc	1.313.028
<b>L&amp;G All Commodities UCITS ETF</b>	<b>\$</b>	Vitesco Technologies Group AG	1.271.278
Upland Software Inc	5.100.427	Be Shaping the Future SpA	1.191.235
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	4.089.943		
Vistry Group Plc	4.045.215		
Philip Morris International Inc	3.884.935		
Deutsche Wohnen SE	3.798.658		
John Menzies Plc	3.509.567		
Siltronic AG	3.425.285		
Christian Dior SE	3.404.210		
Pets at Home Group Plc	3.403.403		
Sopra Steria Group SACA	2.854.111		
<b>L&amp;G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF<sup>1</sup></b>	<b>\$</b>		
HSBC Holdings Plc	39.795.111		
Philip Morris International Inc	39.795.071		
Apple Inc	39.794.926		
Dassault Systemes SE	28.551.358		
Air France-KLM	26.493.760		
Wacker Chemie AG	18.993.383		
HUGO BOSS AG	17.969.196		
Merit Medical Systems Inc	17.458.204		
Edenred	17.376.812		
Vallourec SA	17.120.267		

\* Wenn zum 30. Juni 2021 weniger als zehn Sicherheitenemittenten vorhanden waren, wurden alle Emittenten berücksichtigt.

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

## 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 2022 im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) Sachsicherheiten:

Währung		Währung	
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF</b>	<b>€</b>	<b>L&amp;G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF<sup>1</sup> (Fortsetzung)</b>	<b>\$</b>
Kanadischer Dollar	5.383.624	Euro	392.805.294
Euro	21.414.802	Japanischer Yen	15.021.009
US-Dollar	469	Norwegische Krone	37.276.638
	<b>26.798.895</b>	Britisches Pfund	161.420.037
		Schweizer Franken	2.901.579
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	<b>€</b>	US-Dollar	253.008.069
Kanadischer Dollar	1.967.836		<b>863.489.204</b>
Euro	35.052.798		
US-Dollar	930	<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF</b>	<b>£</b>
	<b>37.021.564</b>	Euro	16.099.871
		US-Dollar	106.262
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF</b>	<b>\$</b>		<b>16.206.133</b>
Australischer Dollar	415.051		
Kanadischer Dollar	95.193	<b>L&amp;G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF</b>	<b>£</b>
Euro	313.934.420	Kanadischer Dollar	1.842.819
Japanischer Yen	4.133.939	Euro	8.285.913
Norwegische Krone	45.242.690	US-Dollar	275.524
Britisches Pfund	133.269.381		<b>10.404.256</b>
Schweizer Franken	4.525.138		
US-Dollar	169.326.405	<b>L&amp;G All Commodities UCITS ETF</b>	<b>\$</b>
	<b>670.942.217</b>	Australischer Dollar	949
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	<b>\$</b>	Euro	54.574.220
Dänische Krone	1.038.055	Japanischer Yen	7.155.129
Euro	14.099.218	Norwegische Krone	6.418.192
Japanischer Yen	7.323.723	Britisches Pfund	24.468.504
Britisches Pfund	4.936.440	US-Dollar	19.084.828
US-Dollar	4.668.745		<b>111.701.822</b>
	<b>32.066.181</b>		
<b>L&amp;G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF<sup>1</sup></b>	<b>\$</b>		
Australischer Dollar	478.052		
Kanadischer Dollar	18.198		
Dänische Krone	560.328		

<sup>1</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

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 2022 aufgeführt:

Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Kontrahenten	L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G All Commodities UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	€	€	\$	£	£	\$	\$	\$
Merrill Lynch International	27.076.328	36.774.800	–	16.159.757	10.443.751	–	–	–
Citigroup Global Markets Limited	–	–	–	–	–	29.294.923	–	–
Barclays Bank Plc	–	–	623.438.724	–	–	–	102.009.070	795.902.955
	<b>27.076.328</b>	<b>36.774.800</b>	<b>623.438.724</b>	<b>16.159.757</b>	<b>10.443.751</b>	<b>29.294.923</b>	<b>102.009.070</b>	<b>795.902.955</b>

Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Kontrahenten	L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G All Commodities UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>
	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten
	€	€	\$	£	£	\$	\$	\$
Merrill Lynch International	26.798.895	37.021.564	–	16.206.133	10.404.256	–	–	–
Citigroup Global Markets Limited	–	–	–	–	–	32.066.181	–	–
Barclays Bank Plc	–	–	670.942.217	–	–	–	111.701.822	863.489.204
	<b>26.798.895</b>	<b>37.021.564</b>	<b>670.942.217</b>	<b>16.206.133</b>	<b>10.404.256</b>	<b>32.066.181</b>	<b>111.701.822</b>	<b>863.489.204</b>

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

OTC-Swaps – Kontrahenten	L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G All Commodities UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>
	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
	€	€	\$	£	£	\$	\$	\$
Merrill Lynch International	(2.098.885)	2.851.623	–	278.323	(202.833)	–	–	–
Citigroup Global Markets Limited	–	–	–	–	–	(869.132)	–	–
Barclays Bank Plc	–	–	(44.009.038)	–	–	–	(6.923.757)	(57.878.638)
	<b>(2.098.885)</b>	<b>2.851.623</b>	<b>(44.009.038)</b>	<b>278.323</b>	<b>(202.833)</b>	<b>(869.132)</b>	<b>(6.923.757)</b>	<b>(57.878.638)</b>

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

## 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 2022:

Fälligkeitsprofil	L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G All Commodities UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>
	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten
	€	€	\$	£	£	\$	\$	\$
Weniger als ein Tag	-	-	-	-	-	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	-	-	-	-	-	-	-	-
Eine Woche bis ein Monat	-	-	-	-	-	-	-	-
Ein bis drei Monate	-	-	-	-	-	-	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-	-	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	26.798.895	37.021.564	11.826.261	16.206.133	10.404.256	-	30	5.438.960
Offene Fälligkeit	-	-	659.115.956	-	-	32.066.181	111.701.792	858.050.244
	<b>26.798.895</b>	<b>37.021.564</b>	<b>670.942.217</b>	<b>16.206.133</b>	<b>10.404.256</b>	<b>32.066.181</b>	<b>111.701.822</b>	<b>863.489.204</b>

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2022:

Fälligkeitsprofil	L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G All Commodities UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	€	€	\$	£	£	\$	\$	\$
Weniger als ein Tag	-	-	-	-	-	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	-	-	-	-	-	-	-	-
Eine Woche bis ein Monat	27.076.328	36.774.800	623.438.724	16.159.757	10.443.751	29.294.923	102.009.070	795.902.955
Ein bis drei Monate	-	-	-	-	-	-	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-	-	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-	-	-	-	-	-	-
Offene Fälligkeit	-	-	-	-	-	-	-	-
	<b>27.076.328</b>	<b>36.774.800</b>	<b>623.438.724</b>	<b>16.159.757</b>	<b>10.443.751</b>	<b>29.294.923</b>	<b>102.009.070</b>	<b>795.902.955</b>

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### III. Transaktionsdaten (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der OTC-Swap-Transaktionen zum 30. Juni 2022:

Marktwerte - OTC-Swap-Transaktionen	L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G All Commodities UCITS ETF	L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF <sup>1</sup>
	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	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	(2.098.885)	2.851.623	(44.009.038)	278.323	(202.833)	(869.132)	(6.923.757)	(57.878.638)
Ein bis drei Monate	-	-	-	-	-	-	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-	-	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-	-	-	-	-	-	-
Offene Fälligkeit	-	-	-	-	-	-	-	-
	(2.098.885)	2.851.623	(44.009.038)	278.323	(202.833)	(869.132)	(6.923.757)	(57.878.638)

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

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.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN

Die technischen Regulierungsstandards („RTS“) gemäß Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“), die Inhalt und Darstellung der regelmäßigen Berichte in Bezug auf die Transparenz der Bewertung ökologischer und/oder sozialer Merkmale und nachhaltiger Investitionen festlegen, sind noch nicht in Kraft getreten.

Obgleich die technischen Bewertungskriterien („TSC“) der Taxonomie-Verordnung der EU („Taxonomie“) im Amtsblatt der Europäischen Union bereits im Dezember 2021 veröffentlicht wurden, beschränkten sich ihre Überlegungen auf die ersten beiden Umweltziele der Taxonomie, namentlich den Klimaschutz und die Anpassung an den Klimawandel. Die TSC für die übrigen vier Umweltziele der Taxonomie stehen noch aus. Ferner werden TSC für den Klimaschutz und die Anpassung an den Klimawandel bei bestimmten Tätigkeiten in Bezug auf Gas und Atomkraft erwartet.

Der Einsatz der TSC erfordert die Verfügbarkeit zahlreicher, spezifischer Daten für jede Investition. Im Berichtszeitraum verfügte die Verwaltungsgesellschaft nicht über ausreichend zuverlässige, zeitnahe und überprüfbare Daten, um die Investitionen auf Basis der TSC einer Bewertung unterziehen zu können.

Es wird erwartet, dass künftige Versionen der von der Gesellschaft veröffentlichten periodischen Offenlegungen umfassend auf die RTS zurückgreifen werden, sobald diese endgültig verfügbar sind und den Marktteilnehmern hierzu zuverlässige, vollständige Daten bereitgestellt werden können.

Die unten aufgeführten Fonds verfolgen nachhaltige Anlageziele und entsprechen Artikel 9 der SFDR.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800GUQHPUIT7GGC50
<b>Nachhaltiges Investitionsziel</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Der Fonds verfolgt ein nachhaltiges Anlageziel, da er in Unternehmen investiert, die (i) zu einem sozialen Ziel beitragen, (ii) keine ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen und (iii) Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung aufweisen. Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Beteiligung an der globalen Branche der sogenannten „Orphan-Arzneimittel“ zu bieten. Orphan-Arzneimittel sind Arzneimittel, die spezifisch zur Behandlung von seltenen Krankheiten oder gesundheitlichen Störungen entwickelt wurden.			
Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?			
Der Fonds erreichte sein Nachhaltigkeitsziel, indem er den Index nachbildete, der ein Engagement in Biotechnologie-Unternehmen bieten soll, die aktiv an der Erforschung, Entwicklung und/oder Herstellung von Orphan-Arzneimitteln beteiligt sind.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?			
Die Unternehmen, die für eine Aufnahme in den Index infrage kommen, wurden auf der Grundlage von Branchenklassifizierungsdaten ermittelt. Letztere wurden von einem unabhängigen Drittanbieter von Konsensprognosen führender Branchenanalysten und Analysen des pharmazeutischen und biotechnologischen Gesundheitssektors bereitgestellt. Um für eine Aufnahme in den Index infrage zu kommen, muss ein Unternehmen mindestens zwei vermarktete Orphan-Arzneimittel als Produkt führen und mit diesen einen Umsatzanteil generieren, der es innerhalb der ersten beiden Quartile maßgeblicher Unternehmen mit Spezialisierung auf Orphan-Arzneimittel ansiedelt, wie von einem unabhängigen Anbieter festgestellt. Nach Bewertung der bestehenden Bestandteile des Index ist LGIM zu dem Schluss gekommen, dass diese Investitionen keine wesentliche Beeinträchtigung ökologischer und sozialer Ziele nach sich ziehen. LGIM hat Verfahren und Kontrollen unter Einsatz von sowohl ökologischen als auch sozialen Indikatoren eingeführt, mit denen halbjährlich überprüft werden soll, ob die Investitionen des Fonds eine erhebliche Beeinträchtigung für diese Ziele mit sich bringen.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Der Fonds berücksichtigt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und hält dabei nach Emittenten Ausschau, die sich nicht an die Grundsätze des UN Global Compact halten.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Aufgrund seiner Anlagen in Unternehmen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, wies der Fonds ein nachhaltiges Anlageziel im Sinne von Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 auf. Folglich wurden bei den Investitionen, die dem Fonds zugrunde liegen, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht berücksichtigt und als solches wurde keine Berechnung zur Anpassung des Portfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das nachhaltige Anlageziel wurde durch die Indexnachbildung des Fonds erreicht. Die Unternehmen, die für eine Aufnahme in den Index infrage kommen, wurden auf der Grundlage von Branchenklassifizierungsdaten ermittelt. Letztere wurden von einem unabhängigen Drittanbieter von Konsensprognosen führender Branchenanalysten und Analysen des pharmazeutischen und biotechnologischen Gesundheitssektors bereitgestellt. Um für eine Aufnahme in den Index infrage zu kommen, muss ein Unternehmen mindestens zwei vermarktete Orphan-Arzneimittel als Produkt führen und mit diesen einen Umsatzanteil generieren, der es innerhalb der ersten beiden Quartile maßgeblicher Unternehmen mit Spezialisierung auf Orphan-Arzneimittel ansiedelt, wie von einem unabhängigen Anbieter festgestellt.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	Auflegung
<b>Fonds</b>	1,63	-1,81	-3,85	37,69	26,66
<b>Referenzwert</b>	1,7	-1,69	-3,44	39,92	29,62

Alle Performancezeiträume mit einer Dauer von mehr als einem Jahr werden annualisiert. Performance der Klasse USD Accumulating ETF, notiert am 23. Januar 2018. Quelle: Lipper. Die Performanceangaben verstehen sich abzüglich aller ETF-Gebühren und unter der Annahme, dass alle mit den Anlagen erzielten Erträge nach Abzug der Steuern im ETF verbleiben.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index unterschied sich von einem breiten Marktindex dahingehend, dass er auf ein Engagement in Biotechnologieunternehmen abzielte, die sich aktiv mit der Erforschung, Entwicklung und/oder Herstellung von Medikamenten für seltene Krankheiten, den sogenannten Orphan-Arzneimitteln, befassen.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Clean Water UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800V5G7YYUFP6542
<b>Nachhaltiges Investitionsziel</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Der Fonds verfolgt ein nachhaltiges Anlageziel, da er in Unternehmen investiert, die (i) zu einem ökologischen Ziel beitragen, (ii) keine ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen und (iii) Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung aufweisen. Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Beteiligung an der globalen Trinkwasserindustrie zu bieten.			
Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?			
Der Fonds erreichte sein Nachhaltigkeitsziel, indem er den Index nachbildete, der ein Engagement in börsennotierten Unternehmen bot, die weltweit in der Trinkwasserindustrie tätig sind und bestimmte Anforderungen an Größe und Liquidität erfüllen.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?			
Der Index schloss Unternehmen aus, die im ESG Exclusions Index enthalten sind, namentlich Unternehmen, die (i) gegen den UN Global Compact verstoßen, (ii) mit einer Kontroverse in Verbindung stehen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse mit schwerwiegenden ökologischen und sozialen Auswirkungen und mit ernsthaften geschäftlichen Risiken für das Unternehmen verwickelt waren), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit zusammenhängenden Produkt/einer damit zusammenhängenden Dienstleistung beteiligt sind, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten beteiligt sind, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen beteiligt sind, (vi) in der Förderung von Kraftwerkskohle, der Kohleverstromung oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen involviert sind und (vii) Beteiligungen an der Förderung von konventionellem Erdöl und Erdgas aufweisen.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der vom Fonds nachgebildete Index schloss Unternehmen auf Grundlage der vorstehend aufgeführten Kriterien aus. Der Fonds wandte bei Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen den ESG Exclusions Index an.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Dieser Fonds investierte in eine Wirtschaftstätigkeit, die zu einem ökologischen Ziel (im Sinne der SFDR) beiträgt. Er ist daher gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) verpflichtet, Informationen über die von ihm getätigten, ökologisch nachhaltigen Investitionen offenzulegen.			
Durch Verwirklichung seines Ziels, nachhaltig zu investieren, hat dieser Fonds zu den folgenden Umweltzielen beigetragen, die in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung aufgeführt sind: (a) Anpassung an den Klimawandel; (b) nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen und (c) Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung.			
Um zur Realisierung dieser Ziele beizutragen, hat der Fonds unter anderem Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten wie die Modernisierung der Abwassersammlung und -behandlung sowie den Bau, Ausbau und Betrieb von Wassersammel-, Abwasserbehandlungs- und Wasserversorgungssystemen getätigt. Obgleich der Fonds in eine Wirtschaftstätigkeit investierte, die zu einem ökologischen Ziel (im Sinne der SFDR) beiträgt, hat er sich nicht dazu verpflichtet, mehr als 0 % seines Vermögens in Anlagen zu investieren, die auf die Taxonomie-Verordnung ausgerichtet sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das nachhaltige Anlageziel wurde dadurch erreicht, dass der Fonds den Index nachbildete, der folgende Komponenten enthielt:

- der Index setzt sich zusammen aus Unternehmen, die weltweit aktiv in der Trinkwasserindustrie tätig sind, sich für die Reinigung und Aufbereitung von Wasser einsetzen und damit einen Beitrag für weniger Wasserverschmutzung und -verschwendung, die Minimierung der Verunreinigung durch Chemikalien, die Verringerung des Anteils unbehandelter Abwässer und die Förderung einer nachhaltigen Bewirtschaftung von Wasserressourcen und Ökosystemen sowie der Abwasserentsorgung leisten; und
- der Index schloss Unternehmen aus, die im „ESG Exclusions Index“ enthalten sind.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	Auflegung
<b>Fonds</b>	5,28	7,83	26,38		70,03
<b>Referenzwert</b>	5,33	7,95	26,84	106,98	71,58

Alle Performancezeiträume mit einer Dauer von mehr als einem Jahr werden annualisiert. Performance der Klasse USD Accumulating ETF, notiert am 2. Juli 2019. Quelle: Lipper. Die Performanceangaben verstehen sich abzüglich aller ETF-Gebühren und unter der Annahme, dass alle mit den Anlagen erzielten Erträge nach Abzug der Steuern im ETF verbleiben.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index unterschied sich von einem breiten Marktindex dahingehend, dass er auf ein Engagement in Unternehmen abzielt, die aktiv an der weltweiten Trinkwasserindustrie beteiligt sind und einen Beitrag für weniger Wasserverschmutzung und -verschwendung, die Minimierung der Verunreinigung durch Chemikalien, die Verringerung des Anteils unbehandelter Abwässer und die Förderung einer nachhaltigen Bewirtschaftung von Wasserressourcen und Ökosystemen sowie der Abwasserentsorgung leisten.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800J61B1UV4KX2A50
<b>Nachhaltiges Investitionsziel</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Der Fonds verfolgt ein nachhaltiges Ziel, da er in Unternehmen investiert, die (i) zu einem sozialen Ziel beitragen, (ii) keine ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen und (iii) Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung aufweisen. Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Beteiligung an der globalen Medizintechnikbranche zu bieten.			
Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?			
Der Fonds erreichte sein Nachhaltigkeitsziel, indem er den Index nachbildete, der ein Engagement in Unternehmen bieten soll, die aktiv an der Wertschöpfungskette der Medizintechnikbranche teilhaben, einen Beitrag für mehr Effizienz und Effektivität im Gesundheitswesen leisten wollen und Fortschritte und Innovation in der Gesundheitsbranche fördern.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?			
Gemäß Index-Methodik wurden Unternehmen ausgeschlossen, die sich nicht an die ESG-Richtlinien von ROBO Global hielten. Dazu gehörten Unternehmen mit dem inakzeptablen Risiko, zu Menschenrechtsverletzungen, schweren Umweltschäden und anderen besonders schwerwiegenden Verstößen gegen grundlegende ethische Prinzipien beizutragen oder dafür verantwortlich zu sein, etwa durch die Herstellung von Waffen, deren gewöhnlicher Einsatz grundlegende humanitäre Prinzipien verletzt. Zudem zielte der Indexanbieter darauf ab sicherzustellen, dass Unternehmen in dem Index keine direkte Beteiligung an fossilen Brennstoffen aufweisen. Im Rahmen der ESG-Bewertung des Indexanbieters wurde die Übereinstimmung der jeweiligen Unternehmen mit den zehn Grundsätzen des UN Global Compact, einschließlich der Menschenrechte, der Arbeitnehmerrechte, der Umweltauswirkungen und der Geschäftsethik, berücksichtigt. Der Indexanbieter bewertete ESG-Faktoren mittels einer Kombination aus internem Research, regelmäßigen Interaktionen mit den im Index aufgeführten Unternehmen sowie der Unterstützung durch führende Anbieter von ESG-Research, um sicherzustellen, dass diese Unternehmen alle Aspekte der ROBO Global ESG Policy erfüllen.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der vom Fonds nachgebildete Index schloss Unternehmen auf Grundlage der vorstehend aufgeführten Kriterien aus. Bei der Nachbildung des Index wandte der Fonds die ROBO Global ESG Policy zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen an.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Aufgrund seiner Anlagen in Unternehmen, die zu einem sozialen Ziel beitragen, wies der Fonds ein nachhaltiges Anlageziel im Sinne von Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 auf. Folglich wurden bei den Investitionen, die dem Fonds zugrunde liegen, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht berücksichtigt und als solches wurde keine Berechnung zur Anpassung des Portfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das nachhaltige Anlageziel wurde dadurch erreicht, dass der Fonds den Index nachbildete, der folgende Komponenten enthielt:

- Der Index setzt sich zusammen aus Unternehmen, die aktiv an der Wertschöpfungskette der Medizintechnikbranche teilhaben, einen Beitrag für mehr Effizienz und Effektivität im Gesundheitswesen leisten wollen und Fortschritte und Innovation in der Gesundheitsbranche fördern; und
- Der Index schloss Unternehmen aus, die sich nicht an die ESG-Richtlinien von ROBO Global hielten. Dazu gehörten Unternehmen mit dem inakzeptablen Risiko, zu Menschenrechtsverletzungen, schweren Umweltschäden und anderen besonders schwerwiegenden Verstößen gegen grundlegende ethische Prinzipien beizutragen oder dafür verantwortlich zu sein, etwa durch die Herstellung von Waffen, deren gewöhnlicher Einsatz grundlegende humanitäre Prinzipien verletzt. Zudem zielte der Indexanbieter darauf ab sicherzustellen, dass Unternehmen in dem Index keine direkte Beteiligung an fossilen Brennstoffen aufweisen. Im Rahmen der ESG-Bewertung des Indexanbieters wurde die Übereinstimmung der jeweiligen Unternehmen mit den zehn Grundsätzen des UN Global Compact, einschließlich der Menschenrechte, der Arbeitnehmerrechte, der Umweltauswirkungen und der Geschäftsethik, berücksichtigt. Der Indexanbieter bewertete ESG-Faktoren mittels einer Kombination aus internem Research, regelmäßigen Interaktionen mit den im Index aufgeführten Unternehmen sowie der Unterstützung durch führende Anbieter von ESG-Research, um sicherzustellen, dass diese Unternehmen alle Aspekte der ROBO Global ESG Policy erfüllen.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

	<b>1 Monat</b>	<b>3 Monate</b>	<b>1 Jahr</b>	<b>3 Jahre</b>	<b>Auflegung</b>
<b>Fonds</b>	1,78	-4,07	0,15		81,63
<b>Referenzwert</b>	1,79	-4	0,35	125,49	83,42

Alle Performancezeiträume mit einer Dauer von mehr als einem Jahr werden annualisiert. Performance der Klasse USD Accumulating ETF, notiert am 2. Juli 2019. Quelle: Lipper. Die Performanceangaben verstehen sich abzüglich aller ETF-Gebühren und unter der Annahme, dass alle mit den Anlagen erzielten Erträge nach Abzug der Steuern im ETF verbleiben.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index unterschied sich von einem breiten Marktindex dahingehend, dass er auf ein Engagement in Unternehmen abzielt, die aktiv an der Wertschöpfungskette der Medizintechnikbranche teilhaben, einen Beitrag für mehr Effizienz und Effektivität im Gesundheitswesen leisten wollen und Fortschritte und Innovation in der Gesundheitsbranche fördern.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Clean Energy UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800YPKIE4MZMQHK38
<b>Nachhaltiges Investitionsziel</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Der Fonds verfolgt ein nachhaltiges Anlageziel, da er in Unternehmen investiert, die (i) zu einem ökologischen Ziel beitragen, (ii) keine ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen und (iii) Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung aufweisen. Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Beteiligung an der globalen Branche für saubere Energie zu bieten.			
Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?			
Der Fonds erreichte sein Nachhaltigkeitsziel, indem er den Index nachbildete, der darauf abzielt, die Performance eines Korbs von Aktien wiederzugeben, die von Unternehmen mit aktiver Beteiligung an der internationalen Branche für saubere Energie emittiert werden. Nur Unternehmen, die in den Bereichen Windkraft, Solarenergie, Meeresenergie, Wasserkraft, Biokraftstoff und/oder Geothermie tätig sind, kommen für eine Aufnahme infrage.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?			
Der Index schloss Unternehmen aus, die auf der Future World Protection List (FWPL) von LGIM geführt werden. Hierzu zählen Unternehmen, die gegen den UN Global Compact (UNGC) verstoßen, einen erheblichen Teil ihrer Umsätze aus dem Abbau, der Erschließung oder der Verarbeitung von Kohle erwirtschaften oder etwa an der Herstellung oder Produktion umstrittener Waffen beteiligt sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der vom Fonds nachgebildete Index schloss Unternehmen auf Grundlage der vorstehend aufgeführten Kriterien aus. Bei der Nachbildung des Index wandte der Fonds die Future World Protection List zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen an.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Dieser Fonds investierte in eine Wirtschaftstätigkeit, die zu einem ökologischen Ziel (im Sinne der SFDR) beiträgt. Er ist daher gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) verpflichtet, Informationen über die von ihm getätigten, ökologisch nachhaltigen Investitionen offenzulegen. Durch Verwirklichung seines Ziels, nachhaltig zu investieren, hat dieser Fonds zu den folgenden Umweltzielen beigetragen, die in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung aufgeführt sind: (a) Klimaschutz und (b) Anpassung an den Klimawandel.			
Um zur Realisierung dieser Ziele beizutragen, hat der Fonds unter anderem Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten wie Stromerzeugung durch Windenergie, Technologien rund um Gezeitenenergie und Wasserkraft, die Installation, Wartung und Reparatur von Energieeffizienzanlagen sowie die Speicherung von Wärmeenergie getätigt. Obwohl der Fonds in eine Wirtschaftstätigkeit investierte, die zu einem ökologischen Ziel (im Sinne der SFDR) beiträgt, hat er sich nicht dazu verpflichtet, mehr als 0 % seines Vermögens in Anlagen zu investieren, die auf die Taxonomie-Verordnung ausgerichtet sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das nachhaltige Anlageziel wurde dadurch erreicht, dass der Fonds den Index nachbildete, der folgende Komponenten enthielt:

- Der Index setzt sich zusammen aus Unternehmen mit aktiver Beteiligung an der Wertschöpfungskette der globalen Branche für saubere Energie, die einen Beitrag zu einem sauberen und nachhaltigen Energie-Ökosystem leisten wollen; und
- Der Index schloss Unternehmen aus, die auf der LGIM Future World Protection List geführt werden.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	Auflegung
<b>Fonds</b>	-1,00	0,45	-6,32		22,19
<b>Referenzwert</b>	-0,97	0,56	-6,04	129,4	22,64

Alle Performancezeiträume mit einer Dauer von mehr als einem Jahr werden annualisiert. Performance der Klasse USD Accumulating ETF, notiert am 11. November 2020. Quelle: Lipper. Die Performanceangaben verstehen sich abzüglich aller ETF-Gebühren und unter der Annahme, dass alle mit den Anlagen erzielten Erträge nach Abzug der Steuern im ETF verbleiben.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index unterschied sich von einem breiten Marktindex dahingehend, dass er auf ein Engagement in Unternehmen mit aktiver Beteiligung an der Wertschöpfungskette der globalen Branche für saubere Energie abzielte, die einen Beitrag zu einem sauberen und nachhaltigen Energie-Ökosystem leisten wollen. Der Index schloss außerdem Unternehmen aus, die auf der Future World Protection List geführt werden. Hierzu zählen Unternehmen, die gegen den UN Global Compact (UNGC) verstoßen, einen erheblichen Teil ihrer Umsätze aus dem Abbau, der Erschließung oder der Verarbeitung von Kohle erwirtschaften oder etwa an der Herstellung oder Produktion umstrittener Waffen beteiligt sind.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800GLU8NT72CLUX55
<b>Nachhaltiges Investitionsziel</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Der Fonds verfolgt ein nachhaltiges Anlageziel, da er in Unternehmen investiert, die (i) zu einem ökologischen Ziel beitragen, (ii) keine ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen und (iii) Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung aufweisen. Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Beteiligung in der Wasserstoffwirtschaft zu bieten.			
Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?			
Der Fonds erreichte sein Nachhaltigkeitsziel, indem er den Index nachbildete, der ein Engagement in Unternehmen bot, die in der globalen Wasserstoffwirtschaft tätig sind und einen Beitrag zu einem verringerten Einsatz herkömmlicher fossiler Brennstoffe sowie zur Förderung sauberer und nachhaltiger Energien leisten wollen.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?			
Der Index schloss Unternehmen aus, die im ESG Exclusions Index enthalten sind, namentlich Unternehmen, die (i) gegen den UN Global Compact verstoßen, (ii) mit einer Kontroverse in Verbindung stehen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse mit schwerwiegenden ökologischen und sozialen Auswirkungen und mit ernsthaften geschäftlichen Risiken für das Unternehmen verwickelt waren), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit zusammenhängenden Produkt/einer damit zusammenhängenden Dienstleistung beteiligt sind, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten beteiligt sind, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen beteiligt sind, (vi) in der Förderung von Kraftwerkskohle, der Kohleverstromung oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen involviert sind (vii) Beteiligungen an der Förderung von konventionellem Erdöl und Erdgas aufweisen.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der vom Fonds nachgebildete Index schloss Unternehmen auf Grundlage der vorstehend aufgeführten Kriterien aus. Der Fonds wandte bei Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen den ESG Exclusions Index an.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Dieser Fonds investierte in eine Wirtschaftstätigkeit, die zu einem ökologischen Ziel (im Sinne der SFDR) beiträgt. Er ist daher gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) verpflichtet, Informationen über die von ihm getätigten, ökologisch nachhaltigen Investitionen offenzulegen.

Durch Verwirklichung seines Ziels, nachhaltig zu investieren, hat dieser Fonds zu den folgenden Umweltzielen beigetragen, die in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung aufgeführt sind: (a) Klimaschutz und (b) Anpassung an den Klimawandel.

Um zur Realisierung dieser Ziele beizutragen, hat der Fonds unter anderem Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten wie Stromerzeugung durch Wasserkraft, die Herstellung von Technologien für erneuerbare Energien und die Speicherung von Wasserstoff getätigt. Obgleich der Fonds in eine Wirtschaftstätigkeit investierte, die zu einem ökologischen Ziel (im Sinne der SFDR) beiträgt, hat er sich nicht dazu verpflichtet, mehr als 0 % seines Vermögens in Anlagen zu investieren, die auf die Taxonomie-Verordnung ausgerichtet sind.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das nachhaltige Anlageziel wurde dadurch erreicht, dass der Fonds den Index nachbildete, der folgende Komponenten enthält:

- Der Index setzt sich zusammen aus Unternehmen, die in der globalen Wasserstoffwirtschaft tätig sind und einen Beitrag zu einem verringerten Einsatz herkömmlicher fossiler Brennstoffe sowie zur Förderung sauberer und nachhaltiger Energien leisten wollen.
- Der Index schloss Unternehmen aus, die im „ESG Exclusions Index“ enthalten sind.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	Auflegung
<b>Fonds</b>	-3,50	-1,40			-27,36
<b>Referenzwert</b>	-3,47	-1,43	-2,43	214,37	-27,27

Alle Performancezeiträume mit einer Dauer von mehr als einem Jahr werden annualisiert. Performance der Klasse USD Accumulating ETF, notiert am 10. Februar 2021. Quelle: Lipper. Die Performanceangaben verstehen sich abzüglich aller ETF-Gebühren und unter der Annahme, dass alle mit den Anlagen erzielten Erträge nach Abzug der Steuern im ETF verbleiben.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index unterschied sich von einem breiten Marktindex dahingehend, dass er auf ein Engagement in Unternehmen abzielte, die in der globalen Wasserstoffwirtschaft tätig sind und einen Beitrag zu einem verringerten Einsatz herkömmlicher fossiler Brennstoffe sowie zur Förderung sauberer und nachhaltiger Energien leisten wollen.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G ESG Green Bond UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800J9H9DWE2MGMB27
<b>Nachhaltiges Investitionsziel</b>			
<b>Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?</b>			
<p>Der Fonds verfolgt ein nachhaltiges Anlageziel, da er in festverzinsliche Wertpapiere von Unternehmen investiert, die (i) zu einem sozialen oder ökologischen Ziel beitragen, (ii) keine ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen und (iii) Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung aufweisen.</p> <p>Das Anlageziel des Fonds besteht darin, ein Engagement in grünen Anleihen aus Industrie- und Schwellenländern zu bieten.</p>			
<b>Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?</b>			
<p>Der Fonds wird passiv verwaltet und verfolgte sein nachhaltiges Anlageziel, indem er darauf abzielte, die Performance des Index nachzubilden, der ein Engagement in grünen Anleihen aus Industrie- und Schwellenländern bot. Grüne Anleihen werden begeben, um Projekte mit positiven ökologischen Ergebnissen und/oder Auswirkungen auf das Klima zu finanzieren.</p>			
<b>Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?</b>			
<p>Der Index wandte Ausschlüsse an, um ein Engagement in potenziell schädlichen Unternehmen zu verbieten. Angewandt wurden dabei folgende Kriterien:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Ausschlüsse gemäß den Ausschlusskriterien von J.P. Morgan</li> </ol> <p>Der Index schließt Emittenten mit Umsätzen aus folgenden Branchen aus: (a) Tabak und (b) Waffen. Ebenfalls ausgeschlossen werden Emittenten, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, wie durch externe Research-Anbieter festgestellt.</p>			
<b>Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?</b>			
<p>Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen basierend auf den vorstehend aufgeführten Kriterien, wie durch J. P. Morgan festgestellt, aus. Im Rahmen des Gewichtungsverfahrens wird der JESG-Score als Mechanismus zur Schwerpunktsetzung verwendet, sodass Emittenten mit höheren ESG-Scores ein höheres Gewicht im Fonds erhalten. Der JESG-Score wurde außerdem als Mechanismus zur Untergewichtung verwendet, d. h. Emittenten mit niedrigeren ESG-Scores kommt im Fonds ein geringeres Gewicht zu. Der Fonds berücksichtigt mittels der Methodik des Indexanbieters die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und hält dabei nach Emittenten Ausschau, die sich nicht an die Grundsätze des UN Global Compact halten.</p>			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Dieser Fonds investierte in eine Wirtschaftstätigkeit, die zu einem ökologischen Ziel (im Sinne der SFDR) beiträgt. Er ist daher gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) verpflichtet, Informationen über die von ihm getätigten, ökologisch nachhaltigen Investitionen offenzulegen. Durch Verwirklichung seines Ziels, nachhaltig zu investieren, hat dieser Fonds zu den folgenden Umweltzielen beigetragen, die in Artikel 9 der Taxonomie-Verordnung aufgeführt sind: (a) Klimaschutz; (b) Anpassung an den Klimawandel; (c) die Nachhaltige Nutzung und der Schutz von Wasser- und Meeresressourcen; (d) der Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft; (e) Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung und (f) der Schutz und die Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme.

Um zur Realisierung dieser Ziele beizutragen, hat der Fonds unter anderem Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten wie Stromerzeugung durch Windenergie, Wasserkraft und Technologien rund um Gezeitenenergie und Wasserkraft, Schienengüterverkehr und die Installation, Wartung und Reparatur von Energieeffizienzanlagen getätigt. Obgleich der Fonds in eine Wirtschaftstätigkeit investierte, die zu einem ökologischen Ziel (im Sinne der SFDR) beiträgt, hat er sich nicht dazu verpflichtet, mehr als 0 % seines Vermögens in Anlagen zu investieren, die auf die Taxonomie-Verordnung ausgerichtet sind.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das nachhaltige Anlageziel wurde dadurch erreicht, dass der Fonds den Index nachbildete, der folgende Komponenten enthielt:

1. Engagement in grünen Anleihen aus Industrie- und Schwellenländern;
2. Anwendung einer ESG-Scoring- und -Filtermethode, um Emittenten grüner Anleihen, die in Bezug auf ESG-Kriterien höher eingestuft sind, und Emissionen „zertifizierter Klimaanleihen“ stärker zu gewichten und grüne Anleihen, die keiner unabhängigen Prüfung unterzogen wurden, unterzugewichten; und
3. der Index schloss Emittenten mit Umsätzen aus folgenden Branchen aus: (a) Tabak und (b) Waffen. Ebenfalls ausgeschlossen wurden Emittenten, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, wie durch externe Research-Anbieter festgestellt.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	Auflegung
<b>Fonds</b>	-1,28	-0,08			-0,6
<b>Referenzwert</b>	-1,25	-0,09	-1,51	12,23	-0,47

Alle Performancezeiträume mit einer Dauer von mehr als einem Jahr werden annualisiert. Performance der Klasse EUR Distributing ETF, notiert am 18. Februar 2021. Quelle: Lipper. Die Performanceangaben verstehen sich abzüglich aller ETF-Gebühren und unter der Annahme, dass alle mit den Anlagen erzielten Erträge nach Abzug der Steuern im ETF verbleiben.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index unterschied sich von einem breiten Marktindex dahingehend, dass er auf ein Engagement in Emittenten abzielt, die einen Beitrag zum Klimaschutz, zur Erhaltung natürlicher Ressourcen und zur Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung leisten.

## **Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Die nachstehend aufgeführten Fonds bewerben verschiedene ökologische und/oder soziale Merkmale und entsprechen Artikel 8 der SFDR.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Gold Mining UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	2138003VQSINWZINLB67
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden durch Nachbildung des Index erreicht, der Unternehmen ausschließt, die in (i) umstrittenen Waffen und/oder (ii) der Produktion von Tabak oder Förderung von herkömmlichen Erdöl und Erdgas, Kraftwerkskohle und/oder Atomenergie involviert sind und/oder (iii) global anerkannte Normen und Standards verletzen, wie in der Methodik des Indexanbieters, Stoxx Ltd (der „ <b>Indexanbieter</b> “) festgelegt.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden vom Fonds durch Nachbildung des Index erreicht, der auch Unternehmen ausschließt. Der Index schließt Unternehmen aus, die gegen weltweit anerkannte Normen und Standards verstoßen oder Gefahr laufen, gegen diese zu verstoßen, wie z. B. die im Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), in den OECD-Leitlinien für multinationale Unternehmen und in den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGPs) verankerten Normen und Standards, sowie Unternehmen, die (i) in umstrittenen Waffen oder (ii) in Produkten wie Tabak, konventionellem Erdöl und Erdgas, Kraftwerkskohle und Kernkraft involviert sind. Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Involvierung“ werden auf Basis der Methodik des Indexanbieters festgestellt.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Nachbildung des Index, wodurch Unternehmen basierend auf den vorstehend erläuterten Kriterien ausgeschlossen wurden.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800V17YF77IO2CZ66
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Der Fonds bewarb soziale und ökologische Merkmale. Die vom Fonds beworbenen Merkmale wurden durch die Nachbildung eines Index (der „ <b>Index</b> “) eingehalten, wodurch Unternehmen ausgeschlossen wurden, die sich nicht an die ROBO Global ESG-Richtlinie halten.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden durch die Nachbildung des Index erreicht, wodurch Unternehmen ausgeschlossen wurden, die sich nicht an die ESG-Richtlinien von ROBO Global hielten. Dazu gehörten unter anderem Unternehmen mit dem inakzeptablen Risiko, zu Menschenrechtsverletzungen, schweren Umweltschäden und anderen besonders schwerwiegenden Verstößen gegen grundlegende ethische Normen beizutragen oder dafür verantwortlich zu sein, etwa der Herstellung von Waffen, deren gewöhnlicher Einsatz grundlegende humanitäre Prinzipien verletzt. Zudem zielte der Indexanbieter darauf ab sicherzustellen, dass Unternehmen in dem Index keine direkte Beteiligung an fossilen Brennstoffen aufweisen. Im Rahmen der ESG-Bewertung des Indexanbieters wurde die Übereinstimmung der jeweiligen Unternehmen mit den zehn Grundsätzen des UN Global Compact, einschließlich der Menschenrechte, der Arbeitnehmerrechte, der Umweltauswirkungen und der Geschäftsethik, berücksichtigt. Der Indexanbieter bewertete ESG-Faktoren mittels einer Kombination aus internem Research, regelmäßigen Interaktionen mit den im Index aufgeführten Unternehmen sowie der Unterstützung durch führende Anbieter von ESG-Research, um sicherzustellen, dass diese Unternehmen alle Aspekte der ROBO Global ESG Policy erfüllen.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der vom Fonds nachgebildete Index schloss Unternehmen auf Grundlage der vorstehend aufgeführten Kriterien aus.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Cyber Security UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800ZSPQ9TKEKVEN40
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden durch Nachbildung des Index erreicht, der Unternehmen ausschließt, die in ernsthaften Kontroversen (wie nachstehend definiert) involviert waren, die Grundsätze des United Nations Global Compact nicht einhalten und/oder in den Branchen Tabak, nicht erneuerbare Energien und Waffen involviert sind.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden vom Fonds durch Nachbildung des Index erreicht, der auch Unternehmen ausschließt. Der Index schließt Unternehmen aus, die (i) nach Feststellung des Datenanbieters in ernststen Kontroversen involviert sind (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse mit schwerwiegenden ökologischen und sozialen Auswirkungen und mit ernsthaften geschäftlichen Risiken für das Unternehmen verwickelt waren); (ii) die Grundsätze des United Nations global Compact nicht einhalten und/oder (iii) in den Branchen Tabak, nicht erneuerbare Energien und Waffen involviert sind. Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Involvierung“ werden auf Basis der Unterlagen des Indexanbieters zur Indexmethodik festgestellt.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Nachbildung des Index, wodurch Unternehmen basierend auf den vorstehend erläuterten Kriterien ausgeschlossen wurden.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800WIWOEUOI6W4M51
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Der Fonds bewarb ökologische Merkmale. Die vom Fonds beworbenen Merkmale wurden durch die Nachbildung des Index eingehalten, der (i) Unternehmen beinhaltet, die Metalle herstellen, welche in erster Linie zur Herstellung von Batterien eingesetzt werden, und Unternehmen, die elektro-chemische Energiespeichertechnologien (d. h. Batterietechnologie) entwickeln und/oder Batterien herstellen, und (ii) Unternehmen ausschließt, die Bestandteil des ESG Exclusions Index sind.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
<p>1. Fondsziel</p> <p>Die vom Fonds beworbenen Merkmale wurden durch die Nachbildung eines Index eingehalten, der Unternehmen beinhaltet, die Metalle herstellen, welche in erster Linie zur Herstellung von Batterien eingesetzt werden, und Unternehmen, die elektro-chemische Energiespeichertechnologien (d. h. Batterietechnologie) entwickeln und/oder Batterien herstellen.</p> <p>2. ESG-Ausschlüsse</p> <p>Der Index schloss Unternehmen aus, die im ESG Exclusions Index enthalten sind, namentlich Unternehmen, die (i) gegen den UN Global Compact verstoßen, (ii) mit einer Kontroverse in Verbindung stehen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse mit schwerwiegenden ökologischen und sozialen Auswirkungen und mit ernsthaften geschäftlichen Risiken für das Unternehmen verwickelt waren), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit zusammenhängenden Produkt/einer damit zusammenhängenden Dienstleistung beteiligt sind, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten beteiligt sind, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen beteiligt sind, (vi) in der Förderung von Kraftwerkskohle, der Kohleverstromung oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen involviert sind (vii) Beteiligungen an der Förderung von konventionellem Erdöl und Erdgas aufweisen.</p>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung des nachhaltigen Anlageziels des Fonds wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der vom Fonds nachgebildete Index schloss Unternehmen auf Grundlage der vorstehend aufgeführten Kriterien aus. Der Fonds wandte bei Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen den ESG Exclusions Index an.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G US Equity UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800SM2UP9MJ84ID02
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden eingehalten, indem Unternehmen ausgeschlossen wurden, die in bestimmten Aktivitäten involviert sind, welche in ökologischer oder sozialer Hinsicht als schädlich gelten. Erreicht wurde dies durch die Anwendung der LGIM Future World Protection List in dem vom Fonds nachgebildeten Index.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
<p>Die Merkmale werden vom Fonds durch Nachbildung des Index eingehalten, was sich auf die Anwendung der Future World Protection List erstreckt.</p> <p>Die Future World Protection List erfasst Unternehmen, die weltweit anerkannte Geschäftspraktiken im Bereich der Nachhaltigkeit oder unsere Mindestanforderungen an die Klimawende nicht erfüllen. Die Liste enthält zwei ökologische und/oder soziale Komponenten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>i. Unternehmen, die 30 % oder mehr ihrer Umsätze (als Prozentsatz ihrer Bilanz) aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung beziehen, werden vom Fonds ausgeschlossen.*</li> <li>ii. Unternehmen, die über einen ununterbrochenen Zeitraum von mindestens drei Jahren (36 Monaten) gegen mindestens eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben, gelten als hartnäckige Übertreter und werden ausgeschlossen.</li> </ul> <p>Außerdem werden Unternehmen, die mit umstrittenen Waffen handeln, ausgeschlossen. Die Ausschlüsse nach dem Kriterium der umstrittenen Waffenausschlüsse waren jedoch nicht der Grund für die Kategorisierung gemäß Artikel 8. Die Future World Protection List wird laufend überwacht und alle sechs Monate aktualisiert. Um die Liste der Unternehmen zu erstellen, die in die Future World Protection List aufgenommen werden, werden Daten von verschiedenen externen ESG-Datenanbietern verwendet.</p> <p><small>*Der Schwellenwert für die Umsätze aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung, der in der zukünftigen Future World Protection List festgelegt ist, wurde im Mai 2022 auf 20 % abgeändert. Davor galt ein Schwellenwert von 30 %.</small></p>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen aus, die auf der Future World Protection List von LGIM geführt werden.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G UK Equity UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800R6W8NQRKNZSI62
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden eingehalten, indem Unternehmen ausgeschlossen wurden, die in bestimmten Aktivitäten involviert sind, welche in ökologischer oder sozialer Hinsicht als schädlich gelten. Erreicht wurde dies durch die Anwendung der LGIM Future World Protection List in dem vom Fonds nachgebildeten Index.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
<p>Die Merkmale werden vom Fonds durch Nachbildung des Index eingehalten, was sich auf die Anwendung der Future World Protection List erstreckt.</p> <p>Die Future World Protection List erfasst Unternehmen, die weltweit anerkannte Geschäftspraktiken im Bereich der Nachhaltigkeit oder unsere Mindestanforderungen an die Klimawende nicht erfüllen. Die Liste enthält zwei ökologische und/oder soziale Komponenten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>i. Unternehmen, die 30 % oder mehr ihrer Umsätze (als Prozentsatz ihrer Bilanz) aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung beziehen, werden vom Fonds ausgeschlossen.*</li> <li>ii. Unternehmen, die über einen ununterbrochenen Zeitraum von mindestens drei Jahren (36 Monaten) gegen mindestens eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben, gelten als hartnäckige Übertreter und werden ausgeschlossen.</li> </ul> <p>Außerdem werden Unternehmen, die mit umstrittenen Waffen handeln, ausgeschlossen. Die Ausschlüsse nach dem Kriterium der umstrittenen Waffenausschlüsse waren jedoch nicht der Grund für die Kategorisierung gemäß Artikel 8. Die Future World Protection List wird laufend überwacht und alle sechs Monate aktualisiert. Um die Liste der Unternehmen zu erstellen, die in die Future World Protection List aufgenommen werden, werden Daten von verschiedenen externen ESG-Datenanbietern verwendet.</p> <p><small>*Der Schwellenwert für die Umsätze aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung, der in der zukünftigen Future World Protection List festgelegt ist, wurde im Mai 2022 auf 20 % abgeändert. Davor galt ein Schwellenwert von 30 %.</small></p>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen aus, die auf der Future World Protection List von LGIM geführt werden.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Japan Equity UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800NBKT25BC62A624
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden eingehalten, indem Unternehmen ausgeschlossen wurden, die in bestimmten Aktivitäten involviert sind, welche in ökologischer oder sozialer Hinsicht als schädlich gelten. Erreicht wurde dies durch die Anwendung der LGIM Future World Protection List in dem vom Fonds nachgebildeten Index.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
<p>Die Merkmale werden vom Fonds durch Nachbildung des Index eingehalten, was sich auf die Anwendung der Future World Protection List erstreckt.</p> <p>Die Future World Protection List erfasst Unternehmen, die weltweit anerkannte Geschäftspraktiken im Bereich der Nachhaltigkeit oder unsere Mindestanforderungen an die Klimawende nicht erfüllen. Die Liste enthält zwei ökologische und/oder soziale Komponenten.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>i. Unternehmen, die 30 % oder mehr ihrer Umsätze (als Prozentsatz ihrer Bilanz) aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung beziehen, werden vom Fonds ausgeschlossen.*</li> <li>ii. Unternehmen, die über einen ununterbrochenen Zeitraum von mindestens drei Jahren (36 Monaten) gegen mindestens eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben, gelten als hartnäckige Übertreter und werden ausgeschlossen.</li> </ul> <p>Außerdem werden Unternehmen, die mit umstrittenen Waffen handeln, ausgeschlossen. Die Ausschlüsse nach dem Kriterium der umstrittenen Waffenausschlüsse waren jedoch nicht der Grund für die Kategorisierung gemäß Artikel 8. Die Future World Protection List wird laufend überwacht und alle sechs Monate aktualisiert. Um die Liste der Unternehmen zu erstellen, die in die Future World Protection List aufgenommen werden, werden Daten von verschiedenen externen ESG-Datenanbietern verwendet.</p> <p><small>*Der Schwellenwert für die Umsätze aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung, der in der zukünftigen Future World Protection List festgelegt ist, wurde im Mai 2022 auf 20 % abgeändert. Davor galt ein Schwellenwert von 30 %.</small></p>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen aus, die auf der Future World Protection List von LGIM geführt werden.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Global Equity UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800YP7LZ2F7O97G56
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden eingehalten, indem Unternehmen ausgeschlossen wurden, die in bestimmten Aktivitäten involviert sind, welche in ökologischer oder sozialer Hinsicht als schädlich gelten. Erreicht wurde dies durch die Anwendung der LGIM Future World Protection List in dem vom Fonds nachgebildeten Index.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
<p>Die Merkmale werden vom Fonds durch Nachbildung eines Index eingehalten, was sich auf die Anwendung der Future World Protection List erstreckt.</p> <p>Die Future World Protection List erfasst Unternehmen, die weltweit anerkannte Geschäftspraktiken im Bereich der Nachhaltigkeit oder unsere Mindestanforderungen an die Klimawende nicht erfüllen. Die Liste enthält zwei ökologische und/oder soziale Komponenten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>i. Unternehmen, die 30 % oder mehr ihrer Umsätze (als Prozentsatz ihrer Bilanz) aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung beziehen, werden vom Fonds ausgeschlossen.*</li> <li>ii. Unternehmen, die über einen ununterbrochenen Zeitraum von mindestens drei Jahren (36 Monaten) gegen mindestens eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben, gelten als hartnäckige Übertreter und werden ausgeschlossen.</li> </ul> <p>Außerdem werden Unternehmen, die mit umstrittenen Waffen handeln, ausgeschlossen. Die Ausschlüsse nach dem Kriterium der umstrittenen Waffenausschlüsse waren jedoch nicht der Grund für die Kategorisierung gemäß Artikel 8.</p> <p>Die Future World Protection List wird laufend überwacht und alle sechs Monate aktualisiert. Um die Liste der Unternehmen zu erstellen, die in die Future World Protection List aufgenommen werden, werden Daten von verschiedenen externen ESG-Datenanbietern verwendet.</p> <p><small>*Der Schwellenwert für die Umsätze aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung, der in der zukünftigen Future World Protection List festgelegt ist, wurde im Mai 2022 auf 20 % abgeändert. Davor galt ein Schwellenwert von 30 %.</small></p>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen aus, die auf der Future World Protection List von LGIM geführt werden.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800UF5J8AYM6VO179
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden eingehalten, indem Unternehmen ausgeschlossen wurden, die in bestimmten Aktivitäten involviert sind, welche in ökologischer oder sozialer Hinsicht als schädlich gelten. Erreicht wurde dies durch die Anwendung der LGIM Future World Protection List in dem vom Fonds nachgebildeten Index.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
<p>Die Merkmale werden vom Fonds durch Nachbildung des Index eingehalten, was sich auf die Anwendung der Future World Protection List erstreckt.</p> <p>Die Future World Protection List erfasst Unternehmen, die weltweit anerkannte Geschäftspraktiken im Bereich der Nachhaltigkeit oder unsere Mindestanforderungen an die Klimawende nicht erfüllen. Die Liste enthält zwei ökologische und/oder soziale Komponenten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>i. Unternehmen, die 30 % oder mehr ihrer Umsätze (als Prozentsatz ihrer Bilanz) aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung beziehen, werden vom Fonds ausgeschlossen.*</li> <li>ii. Unternehmen, die über einen ununterbrochenen Zeitraum von mindestens drei Jahren (36 Monaten) gegen mindestens eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben, gelten als hartnäckige Übertreter und werden ausgeschlossen.</li> </ul> <p>Außerdem werden Unternehmen, die mit umstrittenen Waffen handeln, ausgeschlossen. Die Ausschlüsse nach dem Kriterium der umstrittenen Waffenausschlüsse waren jedoch nicht der Grund für die Kategorisierung gemäß Artikel 8.</p> <p>Die Future World Protection List wird laufend überwacht und alle sechs Monate aktualisiert. Um die Liste der Unternehmen zu erstellen, die in die Future World Protection List aufgenommen werden, werden Daten von verschiedenen externen ESG-Datenanbietern verwendet.</p> <p><small>*Der Schwellenwert für die Umsätze aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung, der in der zukünftigen Future World Protection List festgelegt ist, wurde im Mai 2022 auf 20 % abgeändert. Davor galt ein Schwellenwert von 30 %.</small></p>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen aus, die auf der Future World Protection List von LGIM geführt werden.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	2138002EQ2WSEOQT1X67
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden eingehalten, indem Unternehmen ausgeschlossen wurden, die in bestimmten Aktivitäten involviert sind, welche in ökologischer oder sozialer Hinsicht als schädlich gelten. Erreicht wurde dies durch die Anwendung der LGIM Future World Protection List in dem vom Fonds nachgebildeten Index.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
<p>Die Merkmale werden vom Fonds durch Nachbildung des Index eingehalten, was sich auf die Anwendung der Future World Protection List erstreckt.</p> <p>Die Future World Protection List erfasst Unternehmen, die weltweit anerkannte Geschäftspraktiken im Bereich der Nachhaltigkeit oder unsere Mindestanforderungen an die Klimawende nicht erfüllen. Die Liste enthält zwei ökologische und/oder soziale Komponenten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>i. Unternehmen, die 30 % oder mehr ihrer Umsätze (als Prozentsatz ihrer Bilanz) aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung beziehen, werden vom Fonds ausgeschlossen.*</li> <li>ii. Unternehmen, die über einen ununterbrochenen Zeitraum von mindestens drei Jahren (36 Monaten) gegen mindestens eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben, gelten als hartnäckige Übertreter und werden ausgeschlossen.</li> </ul> <p>Außerdem werden Unternehmen, die mit umstrittenen Waffen handeln, ausgeschlossen. Die Ausschlüsse nach dem Kriterium der umstrittenen Waffenausschlüsse waren jedoch nicht der Grund für die Kategorisierung gemäß Artikel 8.</p> <p>Die Future World Protection List wird laufend überwacht und alle sechs Monate aktualisiert. Um die Liste der Unternehmen zu erstellen, die in die Future World Protection List aufgenommen werden, werden Daten von verschiedenen externen ESG-Datenanbietern verwendet.</p> <p><small>*Der Schwellenwert für die Umsätze aus dem Kohlebergbau oder der Kohleförderung, der in der zukünftigen Future World Protection List festgelegt ist, wurde im Mai 2022 auf 20 % abgeändert. Davor galt ein Schwellenwert von 30 %.</small></p>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen aus, die auf der Future World Protection List von LGIM geführt werden.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	2138002XWANRF8WHGR26
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Der Fonds bewarb soziale und ökologische Merkmale. Die vom Fonds beworbenen Merkmale wurden durch die Nachbildung des Index eingehalten, wodurch Unternehmen ausgeschlossen wurden, die sich nicht an die ROBO Global ESG-Richtlinie halten.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden durch die Nachbildung des Index erreicht, wodurch Unternehmen ausgeschlossen wurden, die sich nicht an die ESG-Richtlinien von ROBO Global hielten. Dazu gehörten auch Unternehmen mit dem inakzeptablen Risiko, zu Menschenrechtsverletzungen, schweren Umweltschäden und anderen besonders schwerwiegenden Verstößen gegen grundlegende ethische Normen beizutragen oder dafür verantwortlich zu sein, etwa der Herstellung von Waffen, deren gewöhnlicher Einsatz grundlegende humanitäre Prinzipien verletzt. Zudem zielte der Indexanbieter darauf ab sicherzustellen, dass Unternehmen in dem Index keine direkte Beteiligung an fossilen Brennstoffen aufweisen. Im Rahmen der ESG-Bewertung des Indexanbieters wurde die Übereinstimmung der jeweiligen Unternehmen mit den zehn Grundsätzen des UN Global Compact, einschließlich der Menschenrechte, der Arbeitnehmerrechte, der Umweltauswirkungen und der Geschäftsethik, berücksichtigt. Der Indexanbieter bewertete ESG-Faktoren mittels einer Kombination aus internem Research, regelmäßigen Interaktionen mit den im Index aufgeführten Unternehmen sowie der Unterstützung durch führende Anbieter von ESG-Research, um sicherzustellen, dass diese Unternehmen alle Aspekte der ROBO Global ESG Policy erfüllen.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der vom Fonds nachgebildete Index schloss Unternehmen auf Grundlage der vorstehend aufgeführten Kriterien aus.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800D92A2YGDJ41K46
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die vom Fonds beworbenen Merkmale wurden durch die Nachbildung eines Index (der „ <b>Index</b> “) eingehalten, der folgende Aspekte beinhaltet: Ausschluss von Unternehmen mit wesentlicher Involvierung im Kohlesektor, hoher CO <sub>2</sub> -Emissionsintensität und von Unternehmen, die vom Foxberry Sustainability Committee (das „Nachhaltigkeitsgremium“) gemäß den Leitlinien der Unterlagen des Nachhaltigkeitsgremiums ausgeschlossen sind.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale wurden dadurch eingehalten, dass der Fonds den Index nachbildete, der folgende Komponenten enthielt: 1. ESG-Ausschlüsse  Die Ausschlussrichtlinien legen die folgenden Kriterien fest, die bestimmen, welche Unternehmen aus dem Index ausgeschlossen werden sollen: a) Unternehmen mit Tätigkeit in folgenden Sektoren: a. Tabak und b. umstrittene Waffen; b) Unternehmen mit wesentlicher Involvierung im Kohlesektor (mehr als 25 % der Umsätze); c) Unternehmen mit wesentlichen verlorenen Vermögenswerten d) die zehn Unternehmen mit der höchsten CO <sub>2</sub> -Emissionsintensität im zugrunde liegenden Universum und e) Unternehmen, die vom Nachhaltigkeitsgremium gemäß den in den Unterlagen des Nachhaltigkeitsgremiums dargelegten Leitlinien ausgeschlossen sind.  Die Liste der Aktien, die nicht durch die Ausschlussrichtlinien ausgeschlossen werden, wurde vom Nachhaltigkeitsgremium festgelegt und dem Indexverwalter zur Prüfung für eine Aufnahme in den Index vorgelegt.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt wurden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Nachbildung des Index, wodurch Unternehmen basierend auf den vorstehend erläuterten Kriterien ausgeschlossen wurden.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800NYIWNL9W5DIL06
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die vom Fonds beworbenen Merkmale wurden durch die Nachbildung eines Index (der „ <b>Index</b> “) eingehalten, der folgende Aspekte beinhaltet: Ausschluss von Unternehmen mit wesentlicher Involvierung im Kohlesektor, hoher CO <sub>2</sub> -Emissionsintensität und von Unternehmen, die vom Foxyberry Sustainability Committee (das „Nachhaltigkeitsgremium“) gemäß den Leitlinien der Unterlagen des Nachhaltigkeitsgremiums ausgeschlossen sind.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale wurden dadurch eingehalten, dass der Fonds den Index nachbildete, der folgende Komponenten enthielt: 1. ESG-Ausschlüsse  Die Ausschlussrichtlinien legen die folgenden Kriterien fest, die bestimmen, welche Unternehmen aus dem Index ausgeschlossen werden sollen: a) Unternehmen mit Tätigkeit in folgenden Sektoren: a. Tabak und b. umstrittene Waffen; b) Unternehmen mit wesentlicher Involvierung im Kohlesektor (mehr als 25 % der Umsätze); c) Unternehmen mit wesentlichen verlorenen Vermögenswerten d) die zehn Unternehmen mit der höchsten CO <sub>2</sub> -Emissionsintensität im zugrunde liegenden Universum und e) Unternehmen, die vom Nachhaltigkeitsgremium gemäß den in den Unterlagen des Nachhaltigkeitsgremiums dargelegten Leitlinien ausgeschlossen sind.  Die Liste der Aktien, die nicht durch die Ausschlussrichtlinien ausgeschlossen werden, wurde vom Nachhaltigkeitsgremium festgelegt und dem Indexverwalter zur Prüfung für eine Aufnahme in den Index vorgelegt.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt wurden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Nachbildung des Index, wodurch Unternehmen basierend auf den vorstehend erläuterten Kriterien ausgeschlossen wurden.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800APRKITDTPSGS59
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden durch Anwendung der Ausschlusskriterien von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> <li>2. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden zudem durch Schwerpunktsetzungen und die Untergewichtung auf Basis der ESG-Scores von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> </ol>			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der die folgenden Merkmale aufweist: <ol style="list-style-type: none"> <li>(i) Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus Kraftwerkskohle erzielen, und von Emittenten, die gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt;</li> <li>(ii) Schwerpunkt in Bezug auf Emittenten, die nach ESG-Kriterien und Ausgabe von grünen Anleihen höher eingestuft sind und</li> <li>(iii) Untergewichtung und Ausschluss von Emittenten mit niedrigerer Einstufung.</li> </ol>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen basierend auf den vorstehend aufgeführten Kriterien, wie durch J. P. Morgan festgestellt, aus. Im Rahmen des Gewichtungsverfahrens wird der JESG-Score als Mechanismus zur Schwerpunktsetzung verwendet, sodass Emittenten mit höheren ESG-Scores ein höheres Gewicht im Fonds erhalten. Der JESG-Score wurde außerdem als Mechanismus zur Untergewichtung verwendet, d. h. Emittenten mit niedrigeren ESG-Scores kommt im Fonds ein geringeres Gewicht zu. Der Fonds berücksichtigt mittels der Methodik des Indexanbieters die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und hält dabei nach Emittenten Ausschau, die sich nicht an die Grundsätze des UN Global Compact halten.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800RYEYWA2DLT6X36
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden durch Anwendung der Ausschlusskriterien von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> <li>2. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden zudem durch Schwerpunktsetzungen und die Untergewichtung auf Basis der ESG-Scores von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> </ol>			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der die folgenden Merkmale aufweist: <ol style="list-style-type: none"> <li>(i) Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus Kraftwerkskohle erzielen, und von Emittenten, die gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt;</li> <li>(ii) Schwerpunkt in Bezug auf Emittenten, die nach ESG-Kriterien und Ausgabe von grünen Anleihen höher eingestuft sind und</li> <li>(iii) Untergewichtung und Ausschluss von Emittenten mit niedrigerer Einstufung.</li> </ol>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen basierend auf den vorstehend aufgeführten Kriterien, wie durch J. P. Morgan festgestellt, aus. Im Rahmen des Gewichtungsverfahrens wird der JESG-Score als Mechanismus zur Schwerpunktsetzung verwendet, sodass Emittenten mit höheren ESG-Scores ein höheres Gewicht im Fonds erhalten. Der JESG-Score wurde außerdem als Mechanismus zur Untergewichtung verwendet, d. h. Emittenten mit niedrigeren ESG-Scores kommt im Fonds ein geringeres Gewicht zu. Der Fonds berücksichtigt mittels der Methodik des Indexanbieters die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und hält dabei nach Emittenten Ausschau, die sich nicht an die Grundsätze des UN Global Compact halten.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800XROKSRGL3IHR64
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden durch Anwendung der Ausschlusskriterien von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> <li>2. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden zudem durch Schwerpunktsetzungen und die Untergewichtung auf Basis der ESG-Scores von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> </ol>			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
<p>Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der die folgenden Merkmale berücksichtigt:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(i) Ausschluss von quasi-staatlichen Emittenten, die Einnahmen aus Kraftwerkskohle erzielen, und von Emittenten, die gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt;</li> <li>(ii) Schwerpunkt in Bezug auf quasi-staatliche Emittenten, die nach ESG-Kriterien und Ausgabe von grünen Anleihen höher eingestuft sind; und</li> <li>(iii) Untergewichtung und Ausschluss von quasi-staatlichen Emittenten mit niedrigerer Einstufung.</li> </ol>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
<p>Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.</p>			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen basierend auf den vorstehend aufgeführten Kriterien, wie durch J. P. Morgan festgestellt, aus. Im Rahmen des Gewichtungsverfahrens wird der JESG-Score als Mechanismus zur Schwerpunktsetzung verwendet, sodass quasi-staatliche Emittenten mit höheren ESG-Scores ein höheres Gewicht im Fonds erhalten. Der JESG-Score wurde außerdem als Mechanismus zur Untergewichtung verwendet, d. h. quasi-staatliche Emittenten mit niedrigeren ESG-Scores kommt im Fonds ein geringeres Gewicht zu. Der Fonds berücksichtigt mittels der Methodik des Indexanbieters die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und hält dabei nach Emittenten Ausschau, die sich nicht an die Grundsätze des UN Global Compact halten.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	2138008QHWVA5WUDSW97
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden durch Schwerpunktsetzungen und die Untergewichtung auf Basis der ESG-Scores von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds den Index nachbildet, der die folgenden Merkmale aufweist:			
(i) Schwerpunkt in Bezug auf Emittenten, die nach ESG-Kriterien und höher eingestuft sind; und			
(ii) Untergewichtung von Emittenten mit niedrigerer Einstufung.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, setzte ein Gewichtungsverfahren ein, bei dem der JESG-Score als Mechanismus zur Schwerpunktsetzung verwendet wird, sodass Emittenten mit höheren ESG-Scores ein höheres Gewicht im Fonds erhalten. Der JESG-Score wurde außerdem als Mechanismus zur Untergewichtung verwendet, d. h. Emittenten mit niedrigeren ESG-Scores kommt im Fonds ein geringeres Gewicht zu.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800RJN816V7AW9Z31
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden durch Anwendung der Ausschlusskriterien von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> <li>2. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden zudem durch Schwerpunktsetzungen und die Untergewichtung auf Basis der ESG-Scores von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> </ol>			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der die folgenden Merkmale aufweist: <ol style="list-style-type: none"> <li>(i) Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus Kraftwerkskohle erzielen, und von Emittenten, die gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt;</li> <li>(ii) Schwerpunkt in Bezug auf Emittenten, die nach ESG-Kriterien und Ausgabe von grünen Anleihen höher eingestuft sind und</li> <li>(iii) Untergewichtung und Ausschluss von Emittenten mit niedrigerer Einstufung.</li> </ol>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen basierend auf den vorstehend aufgeführten Kriterien, wie durch J. P. Morgan festgestellt, aus. Im Rahmen des Gewichtungsverfahrens wird der JESG-Score als Mechanismus zur Schwerpunktsetzung verwendet, sodass Emittenten mit höheren ESG-Scores ein höheres Gewicht im Fonds erhalten. Der JESG-Score wurde außerdem als Mechanismus zur Untergewichtung verwendet, d. h. Emittenten mit niedrigeren ESG-Scores kommt im Fonds ein geringeres Gewicht zu. Der Fonds berücksichtigt mittels der Methodik des Indexanbieters die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und hält dabei nach Emittenten Ausschau, die sich nicht an die Grundsätze des UN Global Compact halten.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800ZBFHCO7362VG69
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
<b>Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?</b>			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
<b>Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?</b>			
<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden durch Anwendung der Ausschlusskriterien von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> <li>2. Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden zudem durch Schwerpunktsetzungen und die Untergewichtung auf Basis der ESG-Scores von J.P. Morgan eingehalten, die in dem durch den Fonds nachgebildeten Index berücksichtigt werden.</li> </ol>			
<b>Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?</b>			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds den Index nachbildet, der die folgenden Merkmale aufweist: <ol style="list-style-type: none"> <li>(i) Ausschluss von Emittenten, die Einnahmen aus Kraftwerkskohle erzielen, und von Emittenten, die gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt;</li> <li>(ii) Schwerpunkt in Bezug auf Emittenten, die nach ESG-Kriterien und Ausgabe von grünen Anleihen höher eingestuft sind und</li> <li>(iii) Untergewichtung und Ausschluss von Emittenten mit niedrigerer Einstufung.</li> </ol>			
<b>Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?</b>			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
<b>Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?</b>			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Nachbildung der Fonds abzielte, schloss Unternehmen basierend auf den vorstehend aufgeführten Kriterien, wie durch J. P. Morgan festgestellt, aus. Im Rahmen des Gewichtungsverfahrens wird der JESG-Score als Mechanismus zur Schwerpunktsetzung verwendet, sodass Emittenten mit höheren ESG-Scores ein höheres Gewicht im Fonds erhalten. Der JESG-Score wurde außerdem als Mechanismus zur Untergewichtung verwendet, d. h. Emittenten mit niedrigeren ESG-Scores kommt im Fonds ein geringeres Gewicht zu. Der Fonds berücksichtigt mittels der Methodik des Indexanbieters die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und hält dabei nach Emittenten Ausschau, die sich nicht an die Grundsätze des UN Global Compact halten.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800IM7TY46NMI4447
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der die folgenden Merkmale aufweist: Ausschluss von Unternehmen mit Engagement im Bereich Kraftwerkskohle oder von Unternehmen, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der folgende Elemente berücksichtigt: Immobilienfonds und Unternehmen, die (i) wesentliche Einnahmen aus der Förderung von Kraftwerkskohle erzielen, (ii) in erheblichem Umfang in der Kohleverstromung tätig sind, (iii) an der Herstellung umstrittener Waffen beteiligt sind oder (iv) nach Feststellung des Indexverwalters gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, werden aus dem Index ausgeschlossen.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt wurden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Nachbildung des Index, wodurch Unternehmen basierend auf den vorstehend erläuterten Kriterien ausgeschlossen wurden.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Europe ex-UK UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800WT66A4M71HVJ88
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der die folgenden Merkmale aufweist: Ausschluss von Unternehmen mit Engagement im Bereich Kraftwerkskohle oder von Unternehmen, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der folgende Elemente berücksichtigt: Immobilienfonds und Unternehmen, die (i) wesentliche Einnahmen aus der Förderung von Kraftwerkskohle erzielen, (ii) in erheblichem Umfang in der Kohleverstromung tätig sind, (iii) an der Herstellung umstrittener Waffen beteiligt sind oder (iv) nach Feststellung des Indexverwalters gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, werden aus dem Index ausgeschlossen.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt wurden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Nachbildung des Index, wodurch Unternehmen basierend auf den vorstehend erläuterten Kriterien ausgeschlossen wurden.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800JWER9KM3ESVM67
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der die folgenden Merkmale aufweist: Ausschluss von Unternehmen mit Engagement im Bereich Kraftwerkskohle oder von Unternehmen, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der folgende Elemente berücksichtigt: Immobilienfonds und Unternehmen, die (i) wesentliche Einnahmen aus der Förderung von Kraftwerkskohle erzielen, (ii) in erheblichem Umfang in der Kohleverstromung tätig sind, (iii) an der Herstellung umstrittener Waffen beteiligt sind oder (iv) nach Feststellung des Indexverwalters gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, werden aus dem Index ausgeschlossen.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt wurden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Nachbildung des Index, wodurch Unternehmen basierend auf den vorstehend erläuterten Kriterien ausgeschlossen wurden.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	2138004AQLVFTRN6UN52
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds den Index nachbildet, der die folgenden Merkmale aufweist: Ausschluss von Unternehmen mit Engagement im Bereich Kraftwerkskohle oder von Unternehmen, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, wie in der Methodik des Indexanbieters festgelegt.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
Die Merkmale werden dadurch eingehalten, dass der Fonds einen Index nachbildet, der folgende Elemente berücksichtigt: Immobilienfonds und Unternehmen, die (i) wesentliche Einnahmen aus der Förderung von Kraftwerkskohle erzielen, (ii) in erheblichem Umfang in der Kohleverstromung tätig sind, (iii) an der Herstellung umstrittener Waffen beteiligt sind oder (iv) nach Feststellung des Indexverwalters gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen, werden aus dem Index ausgeschlossen.			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt wurden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?			
Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Nachbildung des Index, wodurch Unternehmen basierend auf den vorstehend erläuterten Kriterien ausgeschlossen wurden.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

<b>Name des Produkts:</b>	L&G Digital Payments UCITS ETF	<b>Unternehmenskennung:</b>	213800AGBRXNUNMQAL33
<b>Ökologische und/oder soziale Merkmale</b>			
Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
Nein. Obgleich der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewarb, verpflichtete er sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.			
Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?			
Die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds wurden eingehalten, indem Unternehmen ausgeschlossen werden, die im „ESG Exclusions Enhanced Index“ enthalten sind.			
Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?			
<p>Die Merkmale werden vom Fonds durch Nachbildung des Index erreicht, der auch Unternehmen ausschließt, wie im ESG Exclusions Enhanced Index dargelegt.</p> <p>Der Index schließt Unternehmen aus, die Bestandteil des ESG Exclusions Enhanced Index sind, namentlich Unternehmen, die (i) gegen den UN Global Compact verstoßen, (ii) mit einer Kontroverse in Verbindung gebracht stehen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse mit schwerwiegenden ökologischen und sozialen Auswirkungen und mit ernsthaften geschäftlichen Risiken für das Unternehmen verwickelt waren), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen beteiligt sind, (iv) an der Beschaffung von Waffen oder damit zusammenhängenden Produkten beteiligt sind, (v) direkt oder indirekt über Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen beteiligt sind, (vi) am Einzelhandel oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nicht-Angriffswaffen) und an Kunden aus dem Militär-/Gesetzesbereich sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen eine Beteiligung aufweisen, (vii) in der Förderung von Kraftwerkskohle, Kohleverstromung oder Kapazitätserhöhung von Kohleverstromung involviert sind, (viii) an der Gewinnung, Förderung oder Kapazitätserhöhung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen involviert sind, (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 beteiligt sind, (x) an der Produktion, dem Vertrieb, den unterstützenden Produkten oder der Kapazitätserweiterung von Atomenergie eine Beteiligung aufweisen, (xi) an der Produktion von oder dem Einzelhandel mit Alkohol oder den damit verbundenen Dienstleistungen/Produkten beteiligt sind, (xii) im Betrieb, in der Spezialausrüstung oder den unterstützenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen involviert sind und (xiii) an der Produktion oder dem Vertrieb von Erwachsenenunterhaltung Beteiligungen aufweisen. Einige Ausschlüsse und die Definition von „Involvierung“ werden unter Bezugnahme des durch den Indexanbieter veröffentlichten „ESG Exclusions Enhanced Index“ festgelegt.</p>			
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?			
Obwohl der Fonds ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewarb, verpflichtet er sich momentan nicht, „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der SFDR zu tätigen. Folglich gilt es zu beachten, dass bei den diesem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomie-Verordnung“) nicht berücksichtigt werden und als solches keine Berechnungen zur Ausrichtung des Fondsportfolios an die Taxonomie-Verordnung angestellt wurden. Daraus folgt, dass der Fonds sich nicht dazu verpflichtet hat, mehr als 0 % seines Vermögens in Wirtschaftstätigkeiten zu investieren, die gemäß der Taxonomie-Verordnung als ökologisch nachhaltig zu erachten sind.			

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

### NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGEN (FORTSETZUNG)

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Als Teil der ergriffenen Maßnahmen zur Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale des Produkts werden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Der Index, auf dessen Replikation der Fonds abzielte, schloss Unternehmen aus, die im ESG Exclusions Enhanced Index geführt werden. Der Fonds wandte bei Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen den ESG Exclusions Enhanced Index an.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) (Fortsetzung)

Bei allen anderen Fonds, 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. Diese Fonds sind:

### Fonds

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF

L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF

L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF

L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF

L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

L&G All Commodities UCITS ETF

L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF<sup>1</sup>

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF

L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF<sup>2</sup>

L&G India INR Government Bond UCITS ETF<sup>3</sup>

<sup>1</sup> Dieser Fonds wurde am 14. Januar 2022 geschlossen.

<sup>2</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt.

<sup>3</sup> Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 14. Juni 2021 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt.

## L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe spiegelt die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe bzw. Verkäufe innerhalb des Geschäftsjahres übersteigen. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe angegeben werden.

Wenn die Gesamtzahl der Käufe oder Verkäufe im Geschäftsjahr weniger als 20 im beträgt, dann werden alle Käufe oder Verkäufe angegeben.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
528.500	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'A'	430.317
700	Kweichow Moutai Co Ltd 'A'	197.083
20.800	China Merchants Bank Co Ltd 'A'	166.662
142.300	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd 'A'	143.860
6.000	WuXi AppTec Co Ltd 'A'	116.683
13.400	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	108.077
2.400	Ningbo Deye Technology Co Ltd 'A'	101.505
1.100	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	98.792
2.300	Yunnan Energy New Material Co Ltd	95.438
29.700	Industrial Bank Co Ltd 'A'	93.016
8.300	Midea Group Co Ltd	92.605
2.800	Wuliangye Yibin Co Ltd	91.763
2.600	Shede Spirits Co Ltd 'A'	91.550
4.100	Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd	79.786
4.900	China Zhenhua Group Science & Technology Co Ltd	79.349
14.900	East Money Information Co Ltd	75.014
11.400	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	74.693
20.800	Jiangxi Special Electric Motor Co Ltd	72.815
66.400	Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	72.392
21.100	37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	72.274

**L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
2.000	Kweichow Moutai Co Ltd 'A'	561.242
52.900	China Merchants Bank Co Ltd 'A'	412.287
37.600	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	293.704
20.900	Midea Group Co Ltd	221.431
2.500	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	210.854
64.300	Industrial Bank Co Ltd 'A'	188.902
30.300	East Money Information Co Ltd	163.928
4.600	Wuliangye Yibin Co Ltd	154.808
208.400	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'A'	154.400
49.300	Ping An Bank Co Ltd	133.444
9.200	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	123.147
2.300	NAURA Technology Group Co Ltd	122.584
30.400	CITIC Securities Co Ltd 'A'	122.233
5.600	WuXi AppTec Co Ltd 'A'	118.756
225.500	Agricultural Bank of China Ltd 'A'	103.370
17.000	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	103.075
2.200	BYD Co Ltd	99.474
2.800	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd 'A'	97.819
2.000	Yunnan Energy New Material Co Ltd	83.401
10.800	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd 'A'	81.473

L&G DAX<sup>®</sup> Daily 2x Long UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten €
31.223.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.04.2022	31.223.328
30.793.328	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	30.793.328
29.128.328	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	29.128.328
28.683.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.04.2022	28.683.328
27.678.328	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	27.678.328
26.858.328	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	26.858.328
26.126.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	26.126.328
25.970.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	25.970.328
25.588.328	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	25.588.328
25.066.328	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	25.066.328
24.403.328	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	24.403.328
24.115.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	24.115.328
23.996.328	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	23.996.328
23.623.328	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	23.623.328
23.181.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	23.181.328
23.096.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.09.2021	23.096.328
22.771.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.07.2021	22.771.328
22.771.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	22.771.328
22.425.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	22.425.328
22.161.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.09.2021	22.161.328
22.151.328	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	22.151.328
22.028.328	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	22.028.328
21.916.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	21.916.328
21.621.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	21.621.328
21.533.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	21.533.328
20.561.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	20.561.328
20.469.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	20.469.328
20.395.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	20.395.328
20.306.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	20.306.328
19.083.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	19.083.328
18.726.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	18.726.328
18.694.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	18.694.328
18.153.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	18.153.328
17.756.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	17.756.328
16.983.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	16.983.328
16.694.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	16.694.328
13.729.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	13.729.328
12.759.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	12.759.328
11.179.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	11.179.328

L&G DAX<sup>®</sup> Daily 2x Long UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse €
31.223.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.04.2022	31.223.328
30.793.328	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	30.793.328
29.128.328	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	29.128.328
28.683.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.04.2022	28.683.328
27.678.328	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	27.678.328
26.858.328	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	26.858.328
26.126.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	26.126.328
25.970.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	25.970.328
25.588.328	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	25.588.328
24.403.328	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	24.403.328
24.266.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.07.2021	24.266.328
24.115.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	24.115.328
23.996.328	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	23.996.328
23.623.328	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	23.623.328
23.181.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	23.181.328
23.096.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.09.2021	23.096.328
22.771.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	22.771.328
22.771.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.07.2021	22.771.328
22.425.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	22.425.328
22.161.328	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.09.2021	22.161.328
22.151.328	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	22.151.328
22.028.328	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	22.028.328
21.916.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	21.916.328
21.621.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	21.621.328
21.533.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	21.533.328
20.561.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	20.561.328
20.469.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	20.469.328
20.395.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	20.395.328
20.306.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	20.306.328
19.083.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	19.083.328
18.726.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	18.726.328
18.694.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	18.694.328
18.153.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	18.153.328
17.756.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	17.756.328
16.983.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	16.983.328
16.694.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	16.694.328
13.729.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	13.729.586
12.759.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	12.759.328
11.179.328	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	11.179.328

L&G DAX<sup>®</sup> Daily 2x Short UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten €
52.723.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	52.723.800
51.168.800	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.09.2021	51.168.800
49.699.800	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	49.699.800
49.108.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	49.108.800
48.608.800	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	48.608.800
47.522.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	47.522.800
47.333.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	47.333.800
47.079.800	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	47.079.800
45.647.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	45.647.800
45.603.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	45.603.800
45.583.800	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	45.583.800
43.934.800	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	43.934.800
43.747.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	43.747.800
43.258.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	43.258.800
42.106.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	42.106.800
41.603.800	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	41.603.800
41.030.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	41.030.800
40.988.270	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.07.2021	40.988.270
39.553.800	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	39.553.800
39.070.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	39.070.800
38.735.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	38.735.800
38.678.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	38.678.800
38.548.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	38.548.800
37.798.800	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	37.798.800
37.785.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	37.785.800
37.260.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	37.260.800
36.693.800	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	36.693.800
36.438.800	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.04.2022	36.438.800
36.101.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	36.101.800
36.025.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	36.025.800
34.893.800	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	34.893.800
34.843.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	34.843.800
34.088.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	34.088.800
33.648.800	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.04.2022	33.648.800
33.256.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	33.256.800
32.448.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	32.448.800
32.170.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	32.170.800
32.053.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	32.053.800
31.926.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	31.926.800
30.896.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	30.896.800
30.718.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	30.718.800
29.533.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	29.533.800
28.371.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	28.371.800
25.801.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	25.801.800

L&G DAX<sup>®</sup> Daily 2x Short UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse €
52.723.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	52.723.800
51.168.800	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.09.2021	51.168.800
49.699.800	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	49.699.800
49.108.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	49.108.800
48.608.800	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	48.608.800
47.522.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	47.522.800
47.333.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	47.333.800
47.079.800	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	47.079.800
45.647.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	45.647.800
45.603.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	45.603.800
45.583.800	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	45.583.800
43.934.800	Merrill Lynch International	(0,57) %	24.05.2022	43.934.800
43.747.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	24.08.2021	43.747.800
43.258.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	43.258.800
42.703.270	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.07.2021	42.703.270
42.106.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	42.106.800
41.603.800	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	41.603.800
41.030.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	41.030.800
40.988.270	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.07.2021	40.988.270
39.553.800	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	39.553.800
39.070.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	39.070.800
38.735.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	38.735.800
38.678.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	38.678.800
38.548.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	38.548.800
37.798.800	Merrill Lynch International	(0,54) %	22.06.2022	37.798.800
37.785.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	37.785.800
37.260.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.11.2021	37.260.800
36.693.800	Merrill Lynch International	(0,50) %	22.07.2022	36.693.800
36.438.800	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.04.2022	36.438.800
36.101.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	36.101.800
36.025.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	36.025.800
34.843.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	34.843.800
34.088.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	34.088.800
33.648.800	Merrill Lynch International	(0,55) %	22.04.2022	33.648.800
33.256.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	33.256.800
32.448.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	32.448.800
32.170.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.12.2021	32.170.800
32.053.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	22.10.2021	32.053.800
31.926.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	31.926.800
30.896.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.02.2022	30.896.800
30.718.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	30.718.800
29.533.800	Merrill Lynch International	(0,63) %	24.01.2022	29.533.800
28.371.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	28.371.800
25.801.800	Merrill Lynch International	(0,56) %	23.03.2022	25.801.800

## L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
1.082.167.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	1.082.167.992
1.061.104.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.08.2021	1.061.104.992
1.059.085.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.09.2021	1.059.085.992
1.049.382.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.11.2021	1.049.382.992
1.021.319.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.08.2021	1.021.319.992
1.016.080.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.09.2021	1.016.080.992
1.011.877.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	1.011.877.992
1.006.757.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.11.2021	1.006.757.992
1.005.249.000	Barclays Bank Plc	0,23 %	22.07.2021	1.005.249.000
999.303.992	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.10.2021	999.303.992
958.178.992	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.10.2021	958.178.992
939.810.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.09.2021	939.810.992
911.619.724	Barclays Bank Plc	0,76 %	24.05.2022	911.619.724
906.759.724	Barclays Bank Plc	1,10 %	22.06.2022	906.759.724
872.644.724	Barclays Bank Plc	1,10 %	22.06.2022	872.644.724
867.376.724	Barclays Bank Plc	0,57 %	22.04.2022	867.376.724
866.379.724	Barclays Bank Plc	0,76 %	24.05.2022	866.379.724
836.208.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	836.208.724
833.401.724	Barclays Bank Plc	0,57 %	22.04.2022	833.401.724
830.209.724	Barclays Bank Plc	1,10 %	22.06.2022	830.209.724
822.861.724	Barclays Bank Plc	0,29 %	23.03.2022	822.861.724
812.838.724	Barclays Bank Plc	0,24 %	23.02.2022	812.838.724
792.543.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	792.543.724
781.118.724	Barclays Bank Plc	0,24 %	23.02.2022	781.118.724
747.866.724	Barclays Bank Plc	0,29 %	23.03.2022	747.866.724
711.153.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	711.153.724
672.807.724	Barclays Bank Plc	0,23 %	24.01.2022	672.807.724
645.428.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	645.428.724
618.668.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	618.668.724
550.072.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	550.072.992

## L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
1.087.529.000	Barclays Bank Plc	0,23 %	22.07.2021	1.087.529.000
1.082.167.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	1.082.167.992
1.061.104.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.08.2021	1.061.104.992
1.059.085.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.09.2021	1.059.085.992
1.049.382.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.11.2021	1.049.382.992
1.021.319.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.08.2021	1.021.319.992
1.016.080.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.09.2021	1.016.080.992
1.011.877.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	1.011.877.992
1.006.757.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.11.2021	1.006.757.992
1.005.249.000	Barclays Bank Plc	0,23 %	22.07.2021	1.005.249.000
999.303.992	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.10.2021	999.303.992
958.178.992	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.10.2021	958.178.992
939.810.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.09.2021	939.810.992
911.619.724	Barclays Bank Plc	0,76 %	24.05.2022	911.619.724
906.759.724	Barclays Bank Plc	1,10 %	22.06.2022	906.759.724
872.644.724	Barclays Bank Plc	1,10 %	22.06.2022	872.644.724
867.376.724	Barclays Bank Plc	0,57 %	22.04.2022	867.376.724
866.379.724	Barclays Bank Plc	0,76 %	24.05.2022	866.379.724
836.208.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	836.208.724
833.401.724	Barclays Bank Plc	0,57 %	22.04.2022	833.401.724
830.209.724	Barclays Bank Plc	1,10 %	22.06.2022	830.209.724
822.861.724	Barclays Bank Plc	0,29 %	23.03.2022	822.861.724
812.838.724	Barclays Bank Plc	0,24 %	23.02.2022	812.838.724
792.543.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	792.543.724
781.118.724	Barclays Bank Plc	0,24 %	23.02.2022	781.118.724
747.866.724	Barclays Bank Plc	0,29 %	23.03.2022	747.866.724
711.153.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	711.153.724
672.807.724	Barclays Bank Plc	0,23 %	24.01.2022	672.807.724
645.428.724	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	645.428.724
550.072.992	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	550.072.992

## L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten £
21.190.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	21.190.000
19.977.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	19.977.000
18.385.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	18.385.000
18.172.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	18.172.000
17.773.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	17.773.000
17.422.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	17.422.000
17.282.000	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	17.282.000
16.938.000	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	16.938.000
16.800.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	16.800.000
16.790.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	16.790.000
16.557.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	16.557.000
16.528.000	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	16.528.000
16.468.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	16.468.000
16.457.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	16.457.000
15.862.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	15.862.000
15.792.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	15.792.000
15.658.000	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	15.658.000
15.475.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	15.475.000
15.282.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	15.282.000
15.243.000	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	15.243.000
15.223.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	15.223.000
14.640.000	Merrill Lynch International	0,05 %	23.11.2021	14.640.000
14.477.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	14.477.000
14.355.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	14.355.000
14.355.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	14.355.000
14.293.000	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	14.293.000
14.120.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.07.2021	14.120.000
13.757.604	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	13.757.604
13.624.604	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	13.624.604
13.553.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	13.553.000
13.340.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	13.340.000
13.162.000	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	13.162.000
13.115.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.07.2021	13.115.000
13.020.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	13.020.000
12.962.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	12.962.000
12.959.604	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	12.959.604
12.299.604	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	12.299.604
12.057.000	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	12.057.000
10.780.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	10.780.000
10.673.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	10.673.000
10.512.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	10.512.000
9.892.000	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	9.892.000
8.715.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	8.715.000

## L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
21.190.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	21.190.000
19.977.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	19.977.000
18.385.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	18.385.000
18.172.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	18.172.000
17.773.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	17.773.000
17.422.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	17.422.000
17.282.000	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	17.282.000
16.938.000	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	16.938.000
16.800.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	16.800.000
16.790.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	16.790.000
16.557.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	16.557.000
16.528.000	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	16.528.000
16.468.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	16.468.000
16.457.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	16.457.000
15.862.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	15.862.000
15.792.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	15.792.000
15.658.000	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	15.658.000
15.475.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	15.474.994
15.282.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	15.282.000
15.243.000	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	15.243.000
15.223.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	15.223.000
15.015.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.07.2021	15.015.000
14.640.000	Merrill Lynch International	0,05 %	23.11.2021	14.640.000
14.477.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	14.477.000
14.355.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	14.355.000
14.355.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	14.355.000
14.293.000	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	14.293.000
14.120.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.07.2021	14.120.000
13.624.604	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	13.624.604
13.553.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	13.553.000
13.340.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	13.340.000
13.162.000	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	13.162.000
13.115.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.07.2021	13.115.000
13.020.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	13.020.000
12.962.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	12.962.000
12.959.604	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	12.959.604
12.299.604	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	12.299.604
12.057.000	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	12.056.997
10.780.000	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	10.780.000
10.673.000	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	10.673.000
10.512.000	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	10.512.000
9.892.000	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	9.892.000
8.715.000	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	8.715.000

## L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten £
16.046.751	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	16.046.751
14.673.751	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	14.673.751
14.225.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	14.225.751
14.102.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	14.102.751
13.487.751	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	13.487.751
12.997.751	Merrill Lynch International	0,05 %	23.11.2021	12.997.751
12.993.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	12.993.751
12.872.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	12.872.751
12.797.751	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	12.797.751
12.661.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	12.661.751
12.431.751	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	12.431.751
12.392.751	Merrill Lynch International	0,05 %	23.11.2021	12.392.751
12.225.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	12.225.751
12.108.751	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	12.108.751
11.837.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	11.837.751
11.403.751	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	11.403.751
11.401.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	11.401.751
11.366.751	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	11.366.751
11.118.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	11.118.751
10.972.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	10.972.751
10.903.751	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	10.903.751
10.776.751	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	10.776.751
10.741.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	10.741.751
10.596.751	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	10.596.751
10.578.751	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	10.578.751
10.507.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	10.507.751
10.196.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	10.196.751
10.191.751	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	10.191.751
10.168.751	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	10.168.751
10.088.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.07.2021	10.088.751
10.073.751	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	10.073.751
9.930.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	9.930.751
9.926.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	9.926.751
9.751.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	9.751.751
9.208.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	9.208.751
9.100.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	9.100.751
8.582.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	8.582.751
7.291.751	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	7.291.751
6.758.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	6.758.751
6.077.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	6.077.751
5.473.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	5.473.751

## L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
16.046.751	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	16.046.751
14.673.751	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	14.673.751
14.225.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	14.225.751
14.102.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	14.102.751
13.487.751	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	13.487.750
12.997.751	Merrill Lynch International	0,05 %	23.11.2021	12.997.751
12.993.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	12.993.751
12.872.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	12.872.739
12.797.751	Merrill Lynch International	0,20 %	23.02.2022	12.797.751
12.661.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	12.661.751
12.431.751	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	12.431.751
12.392.751	Merrill Lynch International	0,05 %	23.11.2021	12.392.751
12.225.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	12.225.751
12.108.751	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	12.108.751
11.837.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	11.837.747
11.403.751	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	11.403.751
11.401.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	11.401.751
11.366.751	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	11.366.751
11.118.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	11.118.751
10.972.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	10.972.751
10.903.751	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	10.903.751
10.776.751	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	10.776.751
10.741.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	10.741.751
10.596.751	Merrill Lynch International	0,69 %	24.05.2022	10.596.751
10.588.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.07.2021	10.588.751
10.578.751	Merrill Lynch International	1,19 %	22.07.2022	10.578.751
10.507.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	10.507.751
10.196.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	10.196.751
10.191.751	Merrill Lynch International	0,19 %	24.01.2022	10.191.751
10.088.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.07.2021	10.088.751
10.073.751	Merrill Lynch International	0,05 %	24.08.2021	10.073.751
9.930.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	9.930.751
9.926.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.09.2021	9.926.751
9.751.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.10.2021	9.751.751
9.208.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	9.208.751
9.100.751	Merrill Lynch International	0,05 %	22.12.2021	9.100.751
8.582.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	8.582.751
7.291.751	Merrill Lynch International	0,69 %	22.04.2022	7.291.751
6.758.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	6.758.751
6.077.751	Merrill Lynch International	0,44 %	23.03.2022	6.077.751
5.473.751	Merrill Lynch International	0,94 %	22.06.2022	5.473.751

## L&G Russell 2000 US Small Cap Quality UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
1.262	Shockwave Medical Inc			249.510
1.971	Crocs Inc			158.011
2.627	Moelis & Co - Class A			132.882
689	PS Business Parks Inc (REIT)			127.978
1.488	Texas Roadhouse Inc - Class A			120.791
1.589	Lattice Semiconductor Corp			103.890
1.148	Blueprint Medicines Corp			103.338
8.974	Open Lending Corp			100.609
2.001	PotlatchDeltic Corp (REIT)			98.693
3.626	Embecka Corp			97.440
1.461	BJ's Wholesale Club Holdings Inc			94.401
1.024	Atkore Inc			93.649
1.222	UFP Industries Inc			90.807
1.077	Cohen & Steers Inc			89.591
2.227	Ovintiv Inc			87.304
2.910	Zurn Elkay Water Solutions Corp			86.088
1.525	Intra-Cellular Therapies Inc			85.428
2.019	Artisan Partners Asset Management Inc - Class A			85.169
349	Saia Inc			83.311
1.314	Lantheus Holdings Inc			82.554

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
4.964	BJ's Wholesale Club Holdings Inc			324.736
6.132	Ovintiv Inc			266.419
2.975	Blueprint Medicines Corp			196.184
3.562	Lattice Semiconductor Corp			193.194
6.229	Antero Resources Corp			182.627
2.936	Tenet Healthcare Corp			181.010
1.213	Tetra Tech Inc			168.175
1.965	Chesapeake Energy Corp			164.647
781	EastGroup Properties Inc (REIT)			130.932
753	Avis Budget Group Inc			128.633
2.658	KBR Inc			127.274
5.910	Cannae Holdings Inc			127.217
348	Stamps.com Inc			114.698
1.914	PDC Energy Inc			110.807
3.884	Range Resources Corp			100.808
652	LHC Group Inc			98.239
3.378	Equity Commonwealth (REIT)			93.556
1.143	Mimecast Ltd			91.440
1.166	Ensign Group Inc/The			88.378
1.312	Celsius Holdings Inc			86.898

## L&G Gold Mining UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
133.961	Newmont Corp			8.683.306
401.486	Barrick Gold Corp			8.519.505
809.998	Northern Star Resources Ltd			5.267.439
995.643	Kinross Gold Corp			5.217.968
82.327	Agnico Eagle Mines Ltd (Units)			4.553.964
440.391	Fresnillo Plc			4.351.978
232.811	Newcrest Mining Ltd			4.292.312
191.854	AngloGold Ashanti Ltd			3.773.294
275.962	Gold Fields Ltd			3.192.220
285.599	Equinox Gold Corp			1.745.328
523.212	Evolution Mining Ltd			1.582.694
352.369	Coeur Mining Inc			1.491.368
171.840	Lundin Gold Inc			1.400.532
288.748	Yamana Gold Inc (Units)			1.380.900
529.323	IAMGOLD Corp			1.320.392
1.081.021	Argonaut Gold Inc			1.297.687
1.291.913	Westgold Resources Ltd			1.282.621
360.400	Fortuna Silver Mines Inc			1.211.170
62.844	Polymetal International Plc			1.144.283
125.835	Centerra Gold Inc			1.070.063
97.290	Torex Gold Resources Inc			1.052.186
1.074.700	Calibre Mining Corp			1.049.237
122.800	First Majestic Silver Corp			1.008.430
654.105	Regis Resources Ltd			983.592
942.184	St Barbara Ltd			966.596
88.100	Wesdome Gold Mines Ltd			836.291
76.400	Victoria Gold Corp			819.696
120.000	K92 Mining Inc			772.699
98.384	Alamos Gold Inc - Class A			756.784

## L&G Gold Mining UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- termin	Erlöse US\$
180.533	Newmont Corp			12.511.178
399.200	Barrick Gold Corp			8.789.465
187.000	Kirkland Lake Gold Ltd			7.387.355
349.842	Fresnillo Plc			4.479.072
505.300	Centerra Gold Inc			4.130.265
341.631	Gold Fields Ltd			4.052.172
212.032	Newcrest Mining Ltd			4.040.607
168.616	AngloGold Ashanti Ltd			3.214.183
114.835	Pan American Silver Corp			2.596.363
117.109	Pretium Resources Inc			1.690.741
229.500	Yamana Gold Inc (Units)			1.184.506
188.800	Kinross Gold Corp			995.843
162.601	Hecla Mining Co			980.004
915.032	DRDGOLD Ltd			882.337
15.800	Agnico Eagle Mines Ltd (Units)			880.574
386.878	Polymetal International Plc			778.150
175.960	Evolution Mining Ltd			509.074
169.400	IAMGOLD Corp			499.792
65.803	Northern Star Resources Ltd			468.645
152.800	Argonaut Gold Inc			419.241

## L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
34.344.923	Citigroup Global Markets Limited	0,63 %	24.05.2022	34.344.923
33.922.923	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2021	33.922.923
33.338.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	33.338.923
32.934.923	Citigroup Global Markets Limited	0,63 %	24.05.2022	32.934.923
32.698.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	23.11.2021	32.698.923
32.174.923	Citigroup Global Markets Limited	0,97 %	22.06.2022	32.174.923
31.834.923	Citigroup Global Markets Limited	0,44 %	22.04.2022	31.834.923
31.668.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.09.2021	31.668.923
31.488.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	23.11.2021	31.488.923
31.452.923	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2021	31.452.923
31.253.923	Citigroup Global Markets Limited	0,11 %	23.02.2022	31.253.923
31.018.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	31.018.923
30.974.923	Citigroup Global Markets Limited	0,16 %	23.03.2022	30.974.923
30.869.923	Citigroup Global Markets Limited	0,97 %	22.06.2022	30.869.923
30.834.923	Citigroup Global Markets Limited	0,63 %	24.05.2022	30.834.923
30.253.923	Citigroup Global Markets Limited	0,08 %	22.10.2021	30.253.923
30.253.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.09.2021	30.253.923
29.993.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.12.2021	29.993.923
29.793.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.12.2021	29.793.923
29.688.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	29.688.923
29.294.923	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	22.07.2022	29.294.923
29.048.923	Citigroup Global Markets Limited	0,11 %	23.02.2022	29.048.923
28.348.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	28.348.923
28.294.923	Citigroup Global Markets Limited	0,97 %	22.06.2022	28.294.923
28.133.923	Citigroup Global Markets Limited	0,08 %	22.10.2021	28.133.923
27.808.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.12.2021	27.808.923
27.698.923	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	24.01.2022	27.698.923
27.013.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	27.013.923
26.513.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.12.2021	26.513.923
24.573.923	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	24.01.2022	24.573.923

## L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
35.597.923	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2021	35.597.923
34.344.923	Citigroup Global Markets Limited	0,63 %	24.05.2022	34.344.923
33.922.923	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2021	33.922.923
33.338.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	33.338.923
32.934.923	Citigroup Global Markets Limited	0,63 %	24.05.2022	32.934.923
32.698.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	23.11.2021	32.698.923
32.174.923	Citigroup Global Markets Limited	0,97 %	22.06.2022	32.174.923
31.834.923	Citigroup Global Markets Limited	0,44 %	22.04.2022	31.834.923
31.668.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.09.2021	31.668.923
31.488.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	23.11.2021	31.488.923
31.452.923	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2021	31.452.923
31.253.923	Citigroup Global Markets Limited	0,11 %	23.02.2022	31.253.923
31.018.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	31.018.923
30.974.923	Citigroup Global Markets Limited	0,16 %	23.03.2022	30.974.923
30.869.923	Citigroup Global Markets Limited	0,97 %	22.06.2022	30.869.923
30.834.923	Citigroup Global Markets Limited	0,63 %	24.05.2022	30.834.923
30.253.923	Citigroup Global Markets Limited	0,08 %	22.10.2021	30.253.923
30.253.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.09.2021	30.253.923
29.993.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.12.2021	29.993.923
29.793.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.12.2021	29.793.923
29.688.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	29.688.923
29.048.923	Citigroup Global Markets Limited	0,11 %	23.02.2022	29.048.923
28.348.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	28.348.923
28.294.923	Citigroup Global Markets Limited	0,97 %	22.06.2022	28.294.923
28.133.923	Citigroup Global Markets Limited	0,08 %	22.10.2021	28.133.923
27.808.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.12.2021	27.808.923
27.698.923	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	24.01.2022	27.698.923
27.013.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	24.08.2021	27.013.923
26.513.923	Citigroup Global Markets Limited	0,09 %	22.12.2021	26.513.923
24.573.923	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	24.01.2022	24.573.923

## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
5.140.544	AutoStore Holdings Ltd '144A'	18.615.881
177.977	GXO Logistics Inc	13.556.173
342.400	Harmonic Drive Systems Inc	12.533.188
86.351	IPG Photonics Corp	12.416.796
185.435	iRobot Corp	12.063.587
676.952	3D Systems Corp	11.807.064
808.554	Luminar Technologies Inc - Class A	11.503.708
920.479	Samsara Inc	10.234.541
32.059	Illumina Inc	10.041.733
148.110	iRhythm Technologies Inc	10.023.118
536.922	Ocado Group Plc	9.122.273
81.235	Ambarella Inc	8.840.769
397.245	Materialise NV ADR	8.781.312
1.279.655	AppHarvest Inc	8.779.781
89.790	Azenta Inc	8.666.625
270.200	Nabtesco Corp	8.605.118
792.220	Vicarious Surgical Inc	8.448.660
132.531	Cognex Corp	8.110.627
177.621	Cargotec Oyj - Class B	7.972.928
666.688	Hiwin Technologies Corp	7.509.999
10.900	SMC Corp	7.470.954
27.610	Intuitive Surgical Inc	7.445.823
112.334	Renishaw Plc	7.412.733
16.152	Tecan Group AG	6.782.942
54.835	Teradyne Inc	6.764.539
30.700	FANUC Corp	6.695.195
278.100	THK Co Ltd	6.643.892
116.249	FARO Technologies Inc	6.614.159
14.957	Zebra Technologies Corp	6.557.389
196.307	Airtac International Group	6.398.055
27.248	Kardex Holding AG	6.368.825
598.684	Elektro AB	6.315.632
91.287	KION Group AG	6.275.791
405.952	Hexagon AB	6.035.322
42.207	Aptiv Plc	5.705.141
44.780	PTC Inc	5.486.215
72.100	Omron Corp	5.302.057
132.083	Duerr AG	5.289.960
219.500	Fuji Corp/Aichi	4.999.472
10.100	Keyence Corp	4.749.647

**L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
557.906	Vocera Communications Inc	37.586.204
335.549	iRhythm Technologies Inc	36.345.022
1.488.079	Blue Prism Group Plc	24.294.279
175.040	AeroVironment Inc	15.554.043
249.104	Raven Industries Inc	14.349.014
1.017.652	Hollysys Automation Technologies Ltd	13.735.373
95.391	Ambarella Inc	13.575.202
29.207	Teledyne Technologies Inc	12.366.878
18.388	ServiceNow Inc	11.172.922
44.264	NVIDIA Corp	10.646.320
302.349	ATS Automation Tooling Systems Inc	10.590.088
19.765	Intuitive Surgical Inc	9.459.829
291.362	Airtac International Group	9.270.468
498.694	Global Unichip Corp	9.266.987
56.736	Cadence Design Systems Inc	8.933.606
31.013	Kardex Holding AG	8.385.398
63.674	Teradyne Inc	8.317.108
91.120	Azenta Inc	8.014.187
18.903	Deere & Co	7.404.123
433.900	Yokogawa Electric Corp	7.348.613
82.463	Krones AG	7.212.440
61.853	PTC Inc	6.825.052
41.460	QUALCOMM Inc	6.707.234
489.139	Hexagon AB	6.698.509
11.479	Keyence Corp	6.607.283
155.380	GEA Group AG	6.389.939
85.259	Globus Medical Inc	6.068.143
471.678	Advantech Co Ltd	6.009.269
63.620	Omron Corp	5.779.032
165.515	Jenoptik AG	5.721.304
10.438	Tecan Group AG	5.693.170
15.506	Illumina Inc	5.680.820
24.953	Nordson Corp	5.590.056
143.400	Harmonic Drive Systems Inc	5.517.069

## L&G Cyber Security UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
37.700.527	Darktrace Plc	252.482.201
6.609.847	Fastly Inc	160.382.311
736.169	VMware Inc	93.143.555
4.521.239	Cognyte Software Ltd	92.572.850
11.635.566	BlackBerry Ltd	88.945.108
641.334	Splunk Inc	78.188.587
1.786.916	SentinelOne Inc	74.197.002
1.316.952	Cisco Systems Inc	71.638.968
524.772	Check Point Software Technologies Ltd	67.898.957
2.118.278	NetScout Systems Inc	65.834.734
426.327	CyberArk Software Ltd	65.226.426
1.157.300	Trend Micro Inc/Japan	61.754.079
2.222.053	NortonLifeLock Inc	60.400.543
2.827.760	Ping Identity Holding Corp	60.334.499
325.434	CrowdStrike Holdings Inc	59.415.661
503.619	Qualys Inc	59.054.917
513.762	Cloudflare Inc	57.211.208
3.059.249	Mandiant Inc	55.491.299
179.441	Fortinet Inc	55.048.490
1.627.341	Juniper Networks Inc	53.023.108
477.534	Akamai Technologies Inc	51.824.295
2.637.524	Telos Corp	51.216.347
90.459	Palo Alto Networks Inc	45.585.809
13.252.774	NCC Group Plc	37.971.041
1.132.977	Radware Ltd	36.585.736
1.470.882	McAfee Corp	36.271.979
1.753.235	SolarWinds Corp	29.768.186
820.993	Atos SE	29.406.602
1.270.657	KnowBe4 Inc	27.379.723
1.863.791	Rackspace Technology Inc	26.629.621

## L&G Cyber Security UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
7.103.966	Mandiant Inc	157.638.330
12.766.286	Avast PLC '144A'	103.281.856
3.709.533	McAfee Corp	95.110.264
533.737	Proofpoint Inc	92.928.257
16.091.138	Darktrace Plc	71.903.770
1.786.916	SentinelOne Inc	70.282.656
737.172	Mimecast Ltd	54.106.243
90.217	Palo Alto Networks Inc	47.209.194
158.768	Fortinet Inc	47.130.614
385.802	Cloudflare Inc	44.853.262
1.021.494	Ultra Electronics Holdings Plc	44.798.202
4.591.732	BAE Systems Plc	37.166.429
268.138	Splunk Inc	37.045.655
431.648	ManTech International Corp/VA	34.326.446
130.135	CACI International Inc	33.556.474
350.223	Thales SA	33.541.599
3.941.863	Zix Corp	33.197.618
383.122	Science Applications International Corp	31.502.112
341.021	Leidos Holdings Inc	31.472.654
971.138	Radware Ltd	31.373.983
179.137	CyberArk Software Ltd	31.250.479
249.333	Jacobs Engineering Group Inc	30.233.000
124.115	CrowdStrike Holdings Inc	29.135.116
8.223.074	QinetiQ Group Plc	28.531.542
235.997	Qualys Inc	28.269.998
189.617	Check Point Software Technologies Ltd	25.615.364
1.270.657	KnowBe4 Inc	25.241.745
793.834	Juniper Networks Inc	25.148.844
894.030	Ping Identity Holding Corp	24.511.155
440.602	Tenable Holdings Inc	22.642.935
87.593	Zscaler Inc	22.009.413
2.274.714	BlackBerry Ltd	20.965.436
188.329	Rapid7 Inc	20.091.713
1.450.763	A10 Networks Inc	19.705.401
2.154.892	Tufin Software Technologies Ltd	18.300.244

## L&G All Commodities UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
140.899.070	Barclays Bank Plc	0,57 %	22.04.2022	140.899.070
137.581.070	Barclays Bank Plc	0,76 %	24.05.2022	137.581.070
136.479.070	Barclays Bank Plc	1,10 %	22.06.2022	136.479.070
136.479.070	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	136.479.070
130.986.070	Barclays Bank Plc	0,76 %	24.05.2022	130.986.070
129.044.070	Barclays Bank Plc	0,57 %	22.04.2022	129.044.070
128.444.070	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	128.444.070
116.739.070	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	116.739.070
111.616.070	Barclays Bank Plc	0,29 %	23.03.2022	111.616.070
110.585.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.11.2021	110.585.070
102.009.070	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	102.009.070
96.029.070	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.10.2021	96.029.070
88.418.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.09.2021	88.418.070
86.149.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.08.2021	86.149.070
84.465.070	Barclays Bank Plc	0,24 %	23.02.2022	84.465.070
75.093.070	Barclays Bank Plc	0,23 %	24.01.2022	75.093.070
69.808.070	Barclays Bank Plc	0,23 %	24.01.2022	69.808.070
67.864.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	67.864.070
66.060.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.11.2021	66.060.070
63.814.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	63.814.070

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
140.899.070	Barclays Bank Plc	0,57 %	22.04.2022	140.899.070
137.581.070	Barclays Bank Plc	0,76 %	24.05.2022	137.581.070
136.479.070	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	136.479.070
136.479.070	Barclays Bank Plc	1,10 %	22.06.2022	136.479.070
130.986.070	Barclays Bank Plc	0,76 %	24.05.2022	130.986.070
129.044.070	Barclays Bank Plc	0,57 %	22.04.2022	129.044.070
128.444.070	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	128.444.070
116.739.070	Barclays Bank Plc	1,76 %	22.07.2022	116.739.070
111.616.070	Barclays Bank Plc	0,29 %	23.03.2022	111.616.070
110.585.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.11.2021	110.585.070
96.029.070	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.10.2021	96.029.070
88.418.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.09.2021	88.418.070
86.149.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.08.2021	86.149.070
84.465.070	Barclays Bank Plc	0,24 %	23.02.2022	84.465.070
83.859.070	Barclays Bank Plc	0,23 %	22.07.2021	83.859.070
75.093.070	Barclays Bank Plc	0,23 %	24.01.2022	75.093.070
69.808.070	Barclays Bank Plc	0,23 %	24.01.2022	69.808.070
67.864.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	67.864.070
66.060.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.11.2021	66.060.070
63.814.070	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.12.2021	63.814.070

## L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
3.218.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	3.218.553
3.111.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.09.2021	3.111.553
3.111.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	24.08.2021	3.111.553
3.041.553	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.07.2021	3.041.553
3.023.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	3.023.553
2.883.553	Barclays Bank Plc	0,20 %	22.10.2021	2.883.553
1.791.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.09.2021	1.791.553
1.369.553	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.01.2022	1.369.553
1.359.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.12.2021	1.359.553
1.299.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.12.2021	1.299.553
1.299.553	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.01.2022	1.299.553
932.000	Barclays Bank Plc	0,20 %	22.09.2021	932.000
741.000	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	741.000
298.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	298.553
180.000	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	180.000
140.000	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	140.000
70.000	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.12.2021	70.000

Vorstehend aufgeführt sind alle Käufe im Geschäftsjahr.

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
10.061.553	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.07.2021	10.061.553
3.218.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	3.218.553
3.111.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.09.2021	3.111.553
3.111.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	24.08.2021	3.111.553
3.041.553	Barclays Bank Plc	0,22 %	22.07.2021	3.041.553
3.023.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	3.023.553
2.883.553	Barclays Bank Plc	0,20 %	22.10.2021	2.883.553
1.791.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.09.2021	1.791.553
1.369.553	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.01.2022	1.369.553
1.359.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.12.2021	1.359.553
1.299.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.12.2021	1.299.553
1.299.553	Barclays Bank Plc	0,22 %	24.01.2022	1.299.553
932.000	Barclays Bank Plc	0,20 %	22.09.2021	932.000
741.000	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	741.000
298.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	298.553
180.000	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	180.000
140.000	Barclays Bank Plc	0,21 %	23.11.2021	140.000
70.000	Barclays Bank Plc	0,21 %	22.12.2021	70.000

Vorstehend aufgeführt sind alle Verkäufe im Geschäftsjahr.

## L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
110.114	LG Energy Solution Ltd	37.401.816
4.059.274	Allkem Ltd	35.004.632
225.898	Volkswagen AG - Preference	34.955.564
22.861.800	Taiwan Cement Corp	31.808.034
937.163	Renault SA	29.144.154
741.884	Mineral Resources Ltd	25.642.545
610.200	TDK Corp	24.555.044
715.930	BYD Co Ltd 'H'	24.376.935
1.438.600	NGK Insulators Ltd	23.247.545
1.764.300	Sumitomo Electric Industries Ltd	23.094.293
311.886	EnerSys	22.751.179
690.648	AMG Advanced Metallurgical Group NV	22.523.837
2.452.451	Delta Electronics Inc	22.116.659
295.885	Mercedes-Benz Group AG	22.044.485
4.634.500	Nissan Motor Co Ltd	21.942.071
2.110.400	Panasonic Holdings Corp	21.865.879
281.974	General Electric Co	21.785.004
74.583	SolarEdge Technologies Inc	20.351.239
212.408	Bayerische Motoren Werke AG	20.043.598
587.950	ABB Ltd	19.824.864
900.300	GS Yuasa Corp	19.012.267
52.798	Lockheed Martin Corp	18.993.146
35.170	Samsung SDI Co Ltd	18.885.816
23.220	Tesla Inc	18.376.990
29.023	LG Chem Ltd	18.089.304
892.621	Hyundai Electric & Energy System Co Ltd	17.662.004
248.960	Sebang Global Battery Co Ltd	16.456.227
8.516.651	Pilbara Minerals Ltd	16.237.212
67.431	Honeywell International Inc	14.470.017
553.872	Livent Corp	14.147.219
1.346.621	Eos Energy Enterprises Inc	12.202.507
287.000	Toshiba Corp	12.007.205
2.011.400	Bolloré SE	11.218.800
2.048.178	ESS Tech Inc	11.010.638
6.334.310	Rolls-Royce Holdings PLC	10.294.910

## L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
114.815	Lockheed Martin Corp	48.402.723
865.444	Toshiba Corp	37.093.542
173.238	Honeywell International Inc	33.036.756
872.244	BYD Co Ltd 'H'	32.536.831
1.772.171	Hyundai Electric & Energy System Co Ltd	31.127.399
17.549.377	Pilbara Minerals Ltd	30.788.485
7.897.765	Galaxy Resources Ltd	30.724.659
22.557.961	Rolls-Royce Holdings Plc	25.740.758
58.561	LG Chem Ltd	24.889.562
464.533	Sebang Global Battery Co Ltd	22.712.741
561.948	Mineral Resources Ltd	22.621.700
20.861	Tesla Inc	21.418.153
880.680	Showa Denko KK	20.463.649
4.023.663	Bolloré SE	20.338.383
658.334	Brookfield Business Partners LP	19.728.498
702.447	Livent Corp	19.615.200
52.538	SolarEdge Technologies Inc	17.561.321
962.900	GS Yuasa Corp	16.289.596
346.194	AMG Advanced Metallurgical Group NV	11.525.004
3.458.978	Eos Energy Enterprises Inc	6.579.241

## L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
707.498	Endo International Plc	2.012.811
35.978	PTC Therapeutics Inc	1.514.881
53.227	Supernus Pharmaceuticals Inc	1.477.308
20.141	Pharma Mar SA	1.449.318
8.734	Johnson & Johnson	1.445.590
12.903	Horizon Therapeutics Plc	1.388.483
11.773	Ipsen SA	1.376.110
18.946	Nippon Shinyaku Co Ltd	1.347.057
38.620	Xencor Inc	1.326.387
5.884	Biogen Inc	1.271.969
8.077	Jazz Pharmaceuticals Plc	1.264.704
13.718	Novartis AG ADR	1.193.782
10.041	Zai Lab Ltd ADR	1.173.938
51.991	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	1.147.292
18.308	Emergent BioSolutions Inc	922.847
11.236	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	907.375
1.119.690	Sino Biopharmaceutical Ltd	808.885
22.015	Ionis Pharmaceuticals Inc	799.049
77.240	Oxford Biomedica Plc	750.997
3.283	Vertex Pharmaceuticals Inc	695.573
8.051	Sarepta Therapeutics Inc	653.429
8.859	Incyte Corp	650.196
4.847	AbbVie Inc	628.036
110.715	Nektar Therapeutics - Class A	615.067
28.847	Grifols SA	578.133
16.044	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	577.040
1.549	Genmab A/S	573.623
25.626	Swedish Orphan Biovitrum AB	538.338
13.838	Halozyme Therapeutics Inc	531.791
7.891	Bristol-Myers Squibb Co	527.888
6.148	BioMarin Pharmaceutical Inc	514.150
58.092	Amryt Pharma Plc ADR	475.169
17.085	Kyowa Kirin Co Ltd	447.344
4.795	Novartis AG	414.395
3.956	Sanofi	406.320
2.009	United Therapeutics Corp	395.454
1.033	Roche Holding AG	394.597
1.926	CSL Ltd	371.808
2.182	Alnylam Pharmaceuticals Inc	353.558

## L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
53.227	Supernus Pharmaceuticals Inc	1.664.024
14.211	Sanofi	1.464.679
16.659	Nippon Shinyaku Co Ltd	1.436.808
16.242	Novartis AG	1.405.357
3.437	BeiGene Ltd ADR	1.375.639
12.735	Horizon Therapeutics Plc	1.372.354
13.217	Ipsen SA	1.282.526
4.237	Biogen Inc	1.230.221
6.296	Alexion Pharmaceuticals Inc	1.147.770
38.620	Xencor Inc	1.131.255
6.934	Seagen Inc	1.083.493
7.172	Ligand Pharmaceuticals Inc	1.032.431
6.555	AbbVie Inc	1.020.572
18.208	Eisai Co Ltd	929.174
6.845	Jazz Pharmaceuticals Plc	917.591
10.016	Pharma Mar SA	883.532
3.232	Vertex Pharmaceuticals Inc	791.959
40.010	Oxford Biomedica Plc	709.753
25.919	Swedish Orphan Biovitrum AB	672.496
249.572	Endo International Plc	587.400
8.014	Bristol-Myers Squibb Co	569.893
1.210	Genmab A/S	483.530
5.637	Sarepta Therapeutics Inc	440.745
2.385	Johnson & Johnson	415.722
10.041	Zai Lab Ltd ADR	397.256
1.035	Roche Holding AG	391.240
5.271	Incyte Corp	390.652
2.229	Alnylam Pharmaceuticals Inc	377.290
4.205	BioMarin Pharmaceutical Inc	335.385
1.593	United Therapeutics Corp	307.931

## L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
218.122	NTG Nordic Transport Group A/S	17.550.546
1.178.262	Vipshop Holdings Ltd ADR	13.895.606
76.697	Alibaba Group Holding Ltd ADR	12.015.775
477.692	Ocado Group Plc	10.544.435
115.709	XPO Logistics Inc	9.959.624
157.414	GXO Logistics Inc	9.945.930
127.226	Zalando SE	9.775.285
795.894	Clipper Logistics Plc	9.152.736
3.438.684	Kerry Logistics Network Ltd	9.122.067
123.951	Nippon Yusen KK	9.049.776
35.677	FedEx Corp	8.719.862
850.636	Rakuten Group Inc	8.146.143
8.733	Shopify Inc	8.122.671
47.933	Prologis Inc (REIT)	8.028.820
61.731	CJ Logistics Corp	8.018.498
101.971	JD.com Inc ADR	7.995.364
3.294.139	JD Logistics Inc '144A'	7.659.266
20.382	ID Logistics Group	7.508.685
813.062	bpost SA	7.145.993
61.393	TD SYNnex Corp	6.968.668
110.954	Deutsche Post AG	6.689.416
1.671.052	Dimerco Express Corp	6.624.162
93.662	Nippon Express Co Ltd	6.605.369
706.556	Senko Group Holdings Co Ltd	6.170.420
26.576	DSV A/S	6.114.321
137.002	Hitachi Transport System Ltd	6.064.179
1.961	AP Moller - Maersk A/S - Class B	5.864.248
17.296	Kuehne + Nagel International AG	5.863.347
47.129	SPS Commerce Inc	5.841.143
690.677	Japan Post Holdings Co Ltd	5.784.355
42.933	SAP SE	5.761.128
231.994	Kintetsu World Express Inc	5.718.209
37.185	Manhattan Associates Inc	5.661.370
83.898	eBay Inc	5.641.064
38.879	Walmart Inc	5.568.777
73.139	Descartes Systems Group Inc/The	5.503.466
956.208	Bolloré SE	5.459.963
45.319	Expeditors International of Washington Inc	5.438.495
63.585	Oracle Corp	5.424.215
26.856	United Parcel Service Inc	5.367.829
30.801	Concentrix Corp	5.162.708
245.827	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	5.157.187
1.516	Amazon.com Inc	5.134.915
83.182	Mainfreight Ltd	4.995.780
61.053	Ryder System Inc	4.696.197
10.920.355	Sinotrans Ltd	4.492.442

## L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
425.400	Nippon Yusen KK	29.397.701
2.284.222	Clipper Logistics Plc	22.656.972
403.100	Hitachi Transport System Ltd	18.248.252
118.964	SPS Commerce Inc	17.713.379
258.836	JD.com Inc ADR	16.864.090
4.672.986	Dimerco Express Corp	15.886.589
219.855	XPO Logistics Inc	14.800.379
5.125	AP Moller - Maersk A/S - Class B	14.759.177
92.234	Manhattan Associates Inc	14.355.842
182.490	Descartes Systems Group Inc/The	14.194.093
154.186	Oracle Corp	13.705.714
67.218	United Parcel Service Inc	13.535.790
72.848	Concentrix Corp	13.148.620
2.277.947	Bollore SE	12.568.248
85.578	Walmart Inc	12.504.539
157.988	GXO Logistics Inc	12.150.544
5.037.122	Kerry Logistics Network Ltd	12.021.313
54.315	DSV A/S	11.705.880
34.333.000	Sinotrans Ltd	11.478.256
450.800	Kintetsu World Express Inc	11.177.161
189.496	Deutsche Post AG	10.840.499
47.636	FedEx Corp	10.838.231
35.804	Kuehne + Nagel International AG	10.829.272
4.090	Amazon.com Inc	10.807.872
160.482	eBay Inc	10.714.458
99.753	TD SYNEX Corp	10.513.116
9.133	Shopify Inc	10.431.895
175.100	Mainfreight Ltd	10.383.109
129.306	Ryder System Inc	10.354.416
90.647	Expeditors International of Washington Inc	10.324.253
78.708	SAP SE	10.265.124
486.609	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	9.734.266
1.197.500	Japan Post Holdings Co Ltd	9.432.490
977.400	Rakuten Group Inc	9.179.800
66.006	Alibaba Group Holding Ltd ADR	9.042.123
437.552	Ocado Group Plc	9.000.589
1.066.900	Senko Group Holdings Co Ltd	8.926.894
111.947	Zalando SE	8.467.897
70.019	CJ Logistics Corp	8.028.098
1.018.840	bpost SA	7.985.248
796.329	Vipshop Holdings Ltd ADR	7.876.128
113.840	NTG Nordic Transport Group A/S	7.599.852
20.382	ID Logistics Group	6.983.545
94.200	Nippon Express Co Ltd	6.133.307
1.235.833	Wincanton Plc	6.053.086

## L&G US Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
82.692	Apple Inc	12.585.484
37.399	Microsoft Corp	10.302.178
8.820	Amazon.com Inc	6.285.128
31.605	Johnson & Johnson	5.322.468
2.038	Alphabet Inc - Class A	4.938.416
4.709	Tesla Inc	3.930.221
17.385	NVIDIA Corp	3.450.969
1.219	Alphabet Inc	3.116.950
11.833	Meta Platforms Inc - Class A	2.579.059
4.750	UnitedHealth Group Inc	2.310.515
6.922	Berkshire Hathaway Inc - Class B	2.199.397
14.951	JPMorgan Chase & Co	1.955.639
12.186	Procter & Gamble Co/The	1.800.553
21.540	Exxon Mobil Corp	1.776.874
8.239	Visa Inc - Class A	1.715.015
5.385	Home Depot Inc/The	1.648.314
10.085	Chevron Corp	1.575.173
29.678	Pfizer Inc	1.500.752
4.365	Mastercard Inc	1.479.636
9.109	AbbVie Inc	1.361.666

## L&G US Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
21.664	Apple Inc	3.245.986
8.514	Microsoft Corp	2.567.686
463	Amazon.com Inc	1.545.024
518	Alphabet Inc	1.447.479
556	Alphabet Inc - Class A	1.419.018
3.496	Meta Platforms Inc - Class A	1.059.167
4.027	JPMorgan Chase & Co	646.728
767	Tesla Inc	633.883
2.634	NVIDIA Corp	597.783
1.959	Berkshire Hathaway Inc - Class B	580.022
5.876	American Electric Power Co Inc	578.408
1.570	Home Depot Inc/The	527.541
11.487	Bank of America Corp	496.005
3.211	Procter & Gamble Co/The	463.888
12.550	Freeport-McMoRan Inc	463.646
1.075	UnitedHealth Group Inc	457.093
1.960	Visa Inc - Class A	444.250
1.034	Mastercard Inc	368.421
2.059	Walt Disney Co/The	348.702
1.488	PayPal Holdings Inc	346.584

## L&G UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten £
185.080	Shell Plc	3.772.103
25.354	AstraZeneca Plc	2.467.642
316.896	HSBC Holdings Plc	1.609.476
39.465	Unilever Plc	1.427.131
80.484	GlaxoSmithKline Plc	1.344.070
25.992	Rio Tinto Plc	1.306.922
37.101	Diageo Plc	1.295.998
35.034	British American Tobacco Plc	1.197.115
276.981	BP Plc	1.111.292
165.392	Glencore Plc	742.910
20.082	Anglo American Plc	688.776
11.320	Reckitt Benckiser Group Plc	682.281
60.120	National Grid Plc	633.268
29.633	RELX Plc	628.109
438.665	Vodafone Group Plc	551.937
28.008	Compass Group Plc	465.600
1.058.479	Lloyds Banking Group Plc	456.616
43.896	Prudential Plc	434.965
258.453	Barclays Plc	406.193
5.549	London Stock Exchange Group Plc	405.143
11.037	Ashtead Group Plc	363.342
48.814	BAE Systems Plc	361.954
14.344	Experian Plc	342.870
124.686	Tesco Plc	318.872

## L&G UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse £
74.365	Shell Plc	1.394.374
20.030	BHP Group UK Ltd	477.071
10.337	Rio Tinto Plc	449.152
96.389	JD Sports Fashion Plc	181.445
4.332	Ashtead Group Plc	111.924
1.365	London Stock Exchange Group Plc	96.612
15.753	Glencore Plc	72.039
3.670	Clarivate Plc	65.002
21.542	Wm Morrison Supermarkets Plc	61.692
1.627	Diageo Plc	61.479
2.652	Shell Plc	43.956
1.122	Unilever Plc	43.744
12.435	BP Plc	40.886
2.675	GlaxoSmithKline Plc	40.083
9.673	Aviva Plc	39.489
6.658	HSBC Holdings Plc	28.853
2.549	WPP Plc	27.010
8.321	Tesco Plc	22.925
5.149	Evraz Plc	22.890
689	Experian Plc	22.397

**L&G Japan Equity UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
324.200	Toyota Motor Corp	5.428.860
38.300	Sony Group Corp	3.384.207
6.500	Keyence Corp	2.649.992
352.100	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	1.995.452
66.900	Nippon Telegraph & Telephone Corp	1.939.786
4.600	Tokyo Electron Ltd	1.909.634
46.000	Recruit Holdings Co Ltd	1.724.781
12.400	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	1.693.272
3.400	Nintendo Co Ltd	1.520.404
57.700	Daiichi Sankyo Co Ltd	1.402.099
42.900	KDDI Corp	1.397.603
29.000	Hitachi Ltd	1.396.906
40.600	Mitsubishi Corp	1.350.285
32.900	SoftBank Group Corp	1.324.747
8.200	Daikin Industries Ltd	1.296.642
45.600	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	1.275.898
42.500	ITOCHU Corp	1.240.688
46.400	Honda Motor Co Ltd	1.200.974
19.200	Murata Manufacturing Co Ltd	1.174.676
48.100	Mitsui & Co Ltd	1.153.841
37.800	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	1.143.926
146.100	Japan Post Holdings Co Ltd	1.134.273

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
55.300	Toyota Motor Corp	1.199.612
6.800	Sony Group Corp	684.756
1.100	Keyence Corp	522.249
10.800	SoftBank Group Corp	513.821
16.200	Nippon Telegraph & Telephone Corp	460.041
71.800	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	432.396
86	Japan Real Estate Investment Corp (REIT)	420.061
12.100	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	416.255
800	Tokyo Electron Ltd	366.777
600	Nintendo Co Ltd	306.612
1.900	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	290.239
34.700	Japan Post Holdings Co Ltd	288.585
4.500	MEIJI Holdings Co Ltd	273.786
9.100	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	273.381
8.500	KDDI Corp	272.804
1.500	Daikin Industries Ltd	271.355
9.000	Honda Motor Co Ltd	267.186
4.900	Tokio Marine Holdings Inc	263.524
5.800	Recruit Holdings Co Ltd	262.386
33.900	Chugoku Electric Power Co Inc/The	255.543

## L&G Global Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
4.184	Apple Inc	662.609
1.927	Microsoft Corp	581.158
2.972	Johnson & Johnson	491.948
150	Alphabet Inc - Class A	395.158
128	Amazon.com Inc	394.399
1.148	NVIDIA Corp	260.605
8.638	Shell Plc	260.289
290	Tesla Inc	258.496
601	Meta Platforms Inc - Class A	188.535
1.372	Nestle SA	176.782
424	Roche Holding AG	162.169
969	Procter & Gamble Co/The	145.128
963	JPMorgan Chase & Co	132.934
413	Accenture Plc - Class A	131.884
6.800	Toyota Motor Corp	114.649
242	UnitedHealth Group Inc	112.606
149	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	108.408
3.890	BHP Group Ltd	107.220
457	Visa Inc - Class A	104.681
1.467	Realty Income Corp (REIT)	104.021

## L&G Global Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
7.981	Shell Plc	241.893
187	Roche Holding AG	86.013
1.194	Canadian Natural Resources Ltd	76.059
488	Apple Inc	73.661
1.150	Rio Tinto Plc	73.158
508	Nestle SA	66.077
382	Waste Management Inc	61.385
1.648	Suncor Energy Inc	61.038
415	Procter & Gamble Co/The	60.301
623	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	55.152
158	Microsoft Corp	53.152
2.141	BHP Group Ltd	52.603
518	American Electric Power Co Inc	51.613
704	Ashtead Group Plc	43.571
2.032	Cenovus Energy Inc	41.464
27	Mettler-Toledo International Inc	40.075
1.500	Nippon Telegraph & Telephone Corp	38.684
13	Alphabet Inc	38.654
709	Talanx AG	34.370
886	STMicroelectronics NV	32.574
175	Alexion Pharmaceuticals Inc	31.936
844	CSX Corp	29.900

**L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten €
47.334	Nestle SA	5.030.600
11.096	Roche Holding AG	3.329.081
6.577	ASML Holding NV	3.065.996
36.508	Novartis AG	2.846.373
25.729	Novo Nordisk A/S	2.569.375
4.194	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.308.807
42.606	TotalEnergies SE	2.193.162
17.268	Sanofi	1.624.947
4.847	L'Oreal SA	1.572.195
16.892	SAP SE	1.505.811
14.020	Siemens AG	1.491.744
21.317	Prosus NV	1.221.876
6.332	Allianz SE	1.170.734
9.309	Schneider Electric SE	1.134.599
8.311	Air Liquide SA	1.109.289
33.088	STMicroelectronics NV	1.047.599
2.459	Zurich Insurance Group AG	1.006.497
99.435	Iberdrola SA	986.739
15.768	Bayer AG	980.437
51.567	Deutsche Telekom AG	919.410

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse €
22.604	STMicroelectronics NV	706.497
11.505	RWE AG	464.400
18.712	Investor AB	370.390
463	ASML Holding NV	300.070
2.603	Nestle SA	288.910
10.946	Universal Music Group NV	282.924
5.354	Deutsche Wohnen SE	250.231
1.425	BioNTech SE ADR	200.554
3.171	Anheuser-Busch InBev SA/NV	178.664
509	L'Oreal SA	177.588
931	Volkswagen AG - Preference	171.625
1.798	Novartis AG	134.857
6.051	Kesko Oyj	133.688
5.918	Alstom SA	132.109
564	Allianz SE	122.179
5.456	Investor AB	115.291
3.892	Kesko Oyj	114.818
492	DSV A/S	103.470
35.210	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	103.290
5.457	UBS Group AG	101.629
1.525	Cie de Saint-Gobain	95.677
670	Siemens AG	91.590
901	Novo Nordisk A/S	90.346
229	Roche Holding AG	89.591
5.983	Nexi SpA '144A'	88.313
1.876	TotalEnergies SE	86.697

**L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
498.432	BHP Group Ltd	15.900.443
876.400	AIA Group Ltd	9.424.846
60.759	Sea Ltd ADR	8.975.354
124.953	Commonwealth Bank of Australia	8.781.339
35.147	CSL Ltd	7.021.063
94.200	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	5.088.973
238.303	National Australia Bank Ltd	4.780.495
259.301	Westpac Banking Corp	4.151.190
67.700	Jardine Matheson Holdings Ltd	3.971.220
208.994	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	3.887.442
27.652	Macquarie Group Ltd	3.598.503
82.688	Wesfarmers Ltd	3.106.198
125.800	DBS Group Holdings Ltd	2.898.811
331.100	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	2.873.623
122.000	United Overseas Bank Ltd	2.455.182
88.542	Woolworths Group Ltd	2.357.801
239.289	Transurban Group	2.354.089
786.114	Telstra Corp Ltd	2.198.818
814.740	CapitaLand Investment Ltd/Singapore	2.128.545
424.680	China Mengniu Dairy Co Ltd	2.063.792
26.176	Rio Tinto Ltd	1.990.370
128.894	Goodman Group (REIT)	1.959.661

## L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
54.700	Jardine Matheson Holdings Ltd	3.206.898
236.907	CLP Holdings Ltd	2.291.985
28.168	Commonwealth Bank of Australia	2.115.781
326.959	Sydney Airport	2.044.024
160.800	AIA Group Ltd	1.614.716
9.863	Block Inc CDI	1.265.005
53.870	National Australia Bank Ltd	1.173.927
59.375	Westpac Banking Corp	1.005.352
4.676	CSL Ltd	936.510
28.087	BHP Group Ltd	918.007
19.200	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	911.280
318.709	CapitaLand Investment Ltd/Singapore	832.904
36.400	United Overseas Bank Ltd	764.630
15.522	Wesfarmers Ltd	749.141
82.200	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	733.224
4.984	Macquarie Group Ltd	687.073
35.040	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	681.598
21.097	Woolworths Group Ltd	552.022
88.964	Boral Ltd	500.877
81.572	AGL Energy Ltd	483.563
52.617	Crown Resorts Ltd	474.016
18.100	DBS Group Holdings Ltd	431.741
290.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	400.571
216.615	AusNet Services Ltd	395.886

Vorstehend aufgeführt sind alle Verkäufe im Geschäftsjahr.

## L&amp;G Clean Water UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
178.494	Bentley Systems Inc - Class B	9.893.231
956.260	Metso Outotec Oyj	9.387.001
499.015	Pennon Group Plc	8.149.810
108.145	Ingevity Corp	7.730.598
312.826	Core & Main Inc - Class A	7.637.009
85.372	American States Water Co	7.509.446
47.931	Tetra Tech Inc	7.154.279
366.274	NOV Inc	7.076.294
107.330	Itron Inc	6.847.527
166.475	Gorman-Rupp Co/The	6.238.395
67.150	Sulzer AG	6.236.853
135.645	Zurn Elkay Water Solutions Corp	5.384.152
228.272	Uponor Oyj	5.365.522
670.933	Genuit Group Plc	5.118.812
47.570	Xylem Inc/NY	4.929.201
998.914	Rotork Plc	4.642.064
80.799	Aalberts NV	4.499.500
122.229	Alfa Laval AB	4.444.910
296.612	Kemira Oyj	4.362.957
55.585	Trimble Inc	4.359.840
4.212.914	China Water Affairs Group Ltd	4.330.762
60.255	Organo Corp	4.192.510
20.859	Ecolab Inc	4.178.195
63.475	Pentair Plc	4.163.625
105.076	Artesian Resources Corp - Class A	4.138.666
3.047.391	Guangdong Investment Ltd	4.077.047
5.526	Geberit AG	3.972.152
107.398	Norma Group SE	3.924.398
2.386.065	China Lesso Group Holdings Ltd	3.838.086
95.424	Evoqua Water Technologies Corp	3.770.258
263.678	Mueller Water Products Inc - Class A	3.767.840
518.605	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR	3.749.764
24.049	Lindsay Corp	3.666.924
12.238	Danaher Corp	3.665.334
21.976	Watts Water Technologies Inc - Class A	3.582.545
34.802	Badger Meter Inc	3.523.588
1.038.782	TETRA Technologies Inc	3.498.423
2.361	Mettler-Toledo International Inc	3.453.466
33.575	Middlesex Water Co	3.434.887
76.630	Kurita Water Industries Ltd	3.418.770
40.130	Franklin Electric Co Inc	3.381.338
7.154	Roper Technologies Inc	3.375.610
87.845	Severn Trent Plc	3.356.994

**L&G Clean Water UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
19.465	American Water Works Co Inc	3.303.418
228.845	United Utilities Group Plc	3.287.924
160.858	Energy Recovery Inc	3.284.885
15.937	Kadant Inc	3.270.181
48.126	SJW Group	3.253.043
27.915	Advanced Drainage Systems Inc	3.252.832
45.855	A O Smith Corp	3.236.534
53.083	California Water Service Group	3.228.809
8.264.853	Beijing Enterprises Water Group Ltd	3.133.721
132.260	Forterra Inc	3.126.915
352.393	Cadiz Inc	2.920.525
177.674	Primo Water Corp	2.843.928

## L&G Clean Water UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
47.931	Tetra Tech Inc	8.033.226
306.769	Forterra Inc	7.361.489
165.904	Halma Plc	6.938.753
32.652	IDEX Corp	6.510.206
120.099	Essential Utilities Inc	5.600.941
109.113	Evoqua Water Technologies Corp	4.492.179
25.626	Regal Rexnord Corp	4.178.289
151.588	Uponor Oyj	4.154.407
323.062	Consolidated Water Co Ltd	3.261.689
29.407	Middlesex Water Co	3.099.590
339.082	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR	2.999.360
167.040	Primo Water Corp	2.786.149
38.541	Organo Corp	2.497.650
47.865	Artesian Resources Corp - Class A	2.255.039
685.320	TETRA Technologies Inc	2.231.990
1.458	Mettler-Toledo International Inc	2.211.108
6.625	Danaher Corp	2.124.131
54.683	Gorman-Rupp Co/The	2.003.816
114.152	METAWATER Co Ltd	2.000.595
10.954	Watts Water Technologies Inc - Class A	1.837.557
45.301	Norma Group SE	1.832.405
46.070	Severn Trent Plc	1.772.376
3.463	Roper Technologies Inc	1.613.388
13.191	Advanced Drainage Systems Inc	1.603.709
57.770	Northwest Pipe Co	1.598.787
47.793	Medmix AG	1.562.468
1.904	Geberit AG	1.489.260
8.338	American Water Works Co Inc	1.454.368
23.213	Aalberts NV	1.374.757
69.763	Energy Recovery Inc	1.348.600
10.821	Xylem Inc/NY	1.348.210
10.400	Sulzer AG	1.344.157
17.519	Pentair Plc	1.276.537
130.832	Genuit Group Plc	1.229.435
14.015	Trimble Inc	1.221.682
82.870	United Utilities Group Plc	1.182.475
5.647	Kadant Inc	1.178.030

## L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
57.082	Upstart Holdings Inc	7.356.472
50.429	Wix.com Ltd	6.412.390
158.060	Lemonade Inc	6.103.333
41.075	Alibaba Group Holding Ltd ADR	5.634.188
32.240	Twilio Inc - Class A	5.560.589
159.804	C3.ai Inc	5.441.972
8.413	Shopify Inc	5.352.064
739.909	Butterfly Network Inc	5.350.993
1.714.196	Kingdee International Software Group Co Ltd	5.182.632
946.318	Darktrace Plc	5.011.753
4.120	MercadoLibre Inc	4.954.153
156.069	Veracyte Inc	4.919.690
31.287	Block Inc	4.871.771
518.226	Yext Inc	4.772.278
55.079	Cloudflare Inc	4.675.328
64.901	iRobot Corp	4.508.482
29.310	Baidu Inc ADR	4.485.352
12.408	Illumina Inc	4.390.909
31.671	International Business Machines Corp	4.203.470
38.463	Zendesk Inc	4.202.233
43.896	Ambarella Inc	4.197.224
9.613	Fair Isaac Corp	4.179.281
32.621	Splunk Inc	4.157.572
70.907	Tencent Holdings Ltd	4.121.258
152.993	JFrog Ltd	4.001.420
13.805	Atlassian Corp Plc	3.968.921
58.719	Alteryx Inc - Class A	3.917.579
31.243	Etsy Inc	3.860.948
76.016	Varonis Systems Inc - Class B	3.791.540
21.065	Spotify Technology SA	3.770.647
115.614	MediaTek Inc	3.725.926
9.894	Netflix Inc	3.614.515
20.753	Analog Devices Inc	3.472.173
13.410	Veeva Systems Inc - Class A	3.446.601
6.453	HubSpot Inc	3.426.885
49.800	New Relic Inc	3.413.927
11.905	Autodesk Inc	3.290.212
14.750	Arista Networks Inc	3.204.481
33.030	Rapid7 Inc	3.202.848
449.219	Appen Ltd	3.138.819
5.350	Lam Research Corp	3.093.775
13.502	NVIDIA Corp	3.074.872
44.137	Cognex Corp	3.057.171

**L&G Artificial Intelligence UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
8.343	MongoDB Inc - Class A	3.045.121
24.804	Teradyne Inc	2.922.060
26.412	Advanced Micro Devices Inc	2.891.635
37.698	CoStar Group Inc	2.872.860
76.894	Infineon Technologies AG	2.867.121
3.926	ASML Holding NV NY Reg Shrs	2.814.800
1.298	Amazon.com Inc	2.808.538
9.341	Microsoft Corp	2.769.162
109.734	NortonLifeLock Inc	2.744.936
25.760	Fiserv Inc	2.739.656
11.584	Salesforce Inc	2.735.955

## L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
403.200	Blue Prism Group plc	6.698.515
34.277	Aspentech Corp	5.079.556
36.195	Arista Networks Inc	4.798.275
33.502	International Business Machines Corp	4.405.766
31.337	Cloudflare Inc	4.162.736
34.971	Advanced Micro Devices Inc	4.106.959
29.853	Splunk Inc	3.969.693
10.267	Atlassian Corp Plc	3.934.800
67.458	Cornerstone OnDemand Inc	3.853.542
14.739	NVIDIA Corp	3.843.346
8.328	Fair Isaac Corp	3.838.358
1.176.181	Kingdee International Software Group Co Ltd	3.591.218
135.066	McAfee Corp	3.458.759
6.229	Palo Alto Networks Inc	3.297.052
20.327	Analog Devices Inc	3.270.054
2.294	MercadoLibre Inc	3.223.063
21.864	Baidu Inc ADR	3.216.999
3.420	Tesla Inc	3.136.591
10.261	Microsoft Corp	3.057.681
33.124	New Relic Inc	3.053.974
5.015	ServiceNow Inc	2.983.002
25.896	Rapid7 Inc	2.969.952
25.512	Zendesk Inc	2.871.339
46.424	Varonis Systems Inc - Class B	2.664.165
55.805	Veracyte Inc	2.490.427
3.751	HubSpot Inc	2.483.815
64.517	MediaTek Inc	2.452.086
40.696	Alteryx Inc - Class A	2.388.675
11.859	Verisk Analytics Inc - Class A	2.388.443
888	Alphabet Inc - Class A	2.378.497
4.161	Intuit Inc	2.325.299
79.488	Pure Storage Inc	2.294.986
44.334	Tencent Holdings Ltd	2.275.700
4.546	MongoDB Inc - Class A	2.189.649
3.815	Lam Research Corp	2.163.506
10.013	Etsy Inc	2.154.280
41.478	Dassault Systemes SE	2.149.254
106.461	Global Unichip Corp	2.117.097
21.669	Fiserv Inc	2.103.084
101.547	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.091.902
13.513	Teradyne Inc	2.006.870
17.266	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.969.529

**L&G Artificial Intelligence UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
7.143	Nice Ltd ADR	1.892.229
69.207	NortonLifeLock Inc	1.853.987
2.759	ASML Holding NV NY Reg Shrs	1.831.026
14.162	Electronic Arts Inc	1.810.267
836	Booking Holdings Inc	1.784.352
52.586	Infineon Technologies AG	1.770.812

## L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
508.101	Butterfly Network Inc	4.881.371
73.872	Twist Bioscience Corp	4.481.160
55.834	Guardant Health Inc	4.273.602
56.830	Teladoc Health Inc	4.203.479
221.291	Tabula Rasa HealthCare Inc	3.852.091
246.713	Akoya Biosciences Inc	3.847.178
128.644	Grifols SA	3.081.549
655.492	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd '144A'	3.030.058
31.843	Novocure Ltd	2.934.194
50.890	Fate Therapeutics Inc	2.689.320
155.266	Tactile Systems Technology Inc	2.541.434
52.642	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	2.493.390
28.236	STAAR Surgical Co	2.467.429
2.430.185	Alibaba Health Information Technology Ltd	2.396.411
54.942	CareDx Inc	2.297.306
30.964	iRhythm Technologies Inc	2.252.612
45.351	Glaukos Corp	2.239.695
95.422	Health Catalyst Inc	2.200.347
100.040	1Life Healthcare Inc	2.169.525
27.089	Nevro Corp	2.092.104
10.383	Moderna Inc	2.060.464
176.462	Axogen Inc	2.008.511
68.701	Veracyte Inc	2.004.065
38.225	Natera Inc	1.965.994
83.254	Cardiovascular Systems Inc	1.954.214
8.595	Veeva Systems Inc - Class A	1.783.652
68.409	NeoGenomics Inc	1.770.102
80.785	Editas Medicine Inc - Class A	1.759.471
116.184	Codexis Inc	1.735.881
10.728	Alnylam Pharmaceuticals Inc	1.734.484
44.724	Koninklijke Philips NV	1.658.098
77.602	NanoString Technologies Inc	1.617.530
158.509	Collectis SA ADR	1.438.246
15.346	Azenta Inc	1.423.586
9.318	Dexcom Inc	1.387.630
7.769	Penumbra Inc	1.366.238
148.137	JD Health International Inc '144A'	1.350.491

## L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
63.618	iRhythm Technologies Inc	6.980.629
95.886	Vocera Communications Inc	6.326.875
80.862	Editas Medicine Inc - Class A	4.321.601
85.232	Invitae Corp	2.681.779
4.334	Thermo Fisher Scientific Inc	2.620.176
910.584	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd '144A'	2.610.172
157.823	Cardiovascular Systems Inc	2.585.622
246.713	Akoya Biosciences Inc	2.509.602
4.442	Dexcom Inc	2.305.753
3.437	Regeneron Pharmaceuticals Inc	2.200.494
88.499	Artivion Inc	2.178.470
9.246	Vertex Pharmaceuticals Inc	2.165.455
3.368.744	Alibaba Health Information Technology Ltd	2.149.584
6.908	Danaher Corp	2.093.324
14.313	Quidel Corp	2.056.918
38.551	Glaukos Corp	2.035.202
50.251	Veracyte Inc	1.995.836
10.894	PerkinElmer Inc	1.987.763
29.557	Siemens Healthineers AG '144A'	1.976.519
175.706	1Life Healthcare Inc	1.967.319
75.892	Codexis Inc	1.951.221
224.184	Axogen Inc	1.919.794
4.470	Intuitive Surgical Inc	1.822.661
24.152	Hologic Inc	1.813.512
15.054	Catalent Inc	1.780.233
5.507	ABIOMED Inc	1.766.753
364.301	Collectis SA ADR	1.719.396
135.715	NeoGenomics Inc	1.705.643
10.633	Omniceil Inc	1.703.325
2.381	Bio-Rad Laboratories Inc	1.696.980
39.334	Boston Scientific Corp	1.684.363
22.986	Incyte Corp	1.673.987
8.415	DiaSorin SpA	1.622.336
7.169	Masimo Corp	1.604.018
2.005	Lonza Group AG	1.529.258
13.090	Edwards Lifesciences Corp	1.508.464
8.013	Medpace Holdings Inc	1.499.981
19.087	Fulgent Genetics Inc	1.490.906
21.064	Bristol-Myers Squibb Co	1.449.463
5.809	IQVIA Holdings Inc	1.444.332
22.081	Integra LifeSciences Holdings Corp	1.437.316
2.690	Tecan Group AG	1.424.246
3.886	Charles River Laboratories International Inc	1.409.433
11.073	Eurofins Scientific SE	1.389.240
3.509	Roche Holding AG	1.372.969

## L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten €
7.374	Linde Plc	2.028.361
26.971	Prosus NV	1.605.683
9.641	AstraZeneca Plc	985.887
8.878	Nestle SA	963.334
2.776	Roche Holding AG	869.108
14.539	Rio Tinto Plc	862.580
15.065	Anglo American Plc	655.781
1.062	ASML Holding NV	589.464
949	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	574.820
55.160	Nordea Bank Abp	573.174
10.394	CRH Plc	428.236
5.169	Novartis AG	406.035
23.719	Swedbank AB	395.424
3.582	Novo Nordisk A/S	349.717
49.113	HSBC Holdings Plc	277.120
2.895	Groupe Bruxelles Lambert SA	254.026
17.269	Danske Bank A/S	242.707
1.720	Schneider Electric SE	229.140
5.152	Unilever Plc	223.188
2.428	Sanofi	221.831

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse €
45.146	Nestle SA	5.180.971
6.760	ASML Holding NV	4.650.638
14.373	Linde Plc	4.068.040
11.439	Roche Holding AG	3.862.953
4.452	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	3.085.489
34.665	Novartis AG	2.563.800
25.640	Novo Nordisk A/S	2.477.584
23.573	AstraZeneca Plc	2.409.128
16.275	SAP SE	1.908.586
41.079	Unilever Plc	1.890.640
12.230	Siemens AG	1.814.460
23.687	Mercedes-Benz Group AG	1.790.494
327.028	HSBC Holdings Plc	1.747.555
38.068	Diageo Plc	1.720.653
28.361	Prosus NV	1.687.146
29.199	Rio Tinto Plc	1.676.176
17.485	Sanofi	1.555.253
3.791	L'Oreal SA	1.512.585
26.675	Bayer AG	1.461.566
76.154	GlaxoSmithKline Plc	1.390.841

## L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
133.146	Apple Inc	18.053.235
46.935	Amazon.com Inc	10.384.183
8.941	Tesla Inc	6.599.415
15.070	Microsoft Corp	4.596.936
99.885	Wells Fargo & Co	3.761.046
19.524	Johnson & Johnson	3.300.272
17.859	NVIDIA Corp	3.288.458
71.717	Freeport-McMoRan Inc	2.519.283
17.855	Procter & Gamble Co/The	2.435.753
23.334	ROBLOX Corp	2.215.755
741	Alphabet Inc	2.054.169
8.812	Air Products & Chemicals Inc	2.018.756
3.434	BlackRock Inc	2.011.735
40.272	Pfizer Inc	1.932.525
7.573	Coinbase Global Inc	1.833.718
30.726	Coca-Cola Co/The	1.798.467
78.248	Lucid Group Inc	1.709.797
3.337	Broadcom Inc	1.698.076
41.878	Intel Corp	1.694.424
3.203	Thermo Fisher Scientific Inc	1.685.529

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
361.721	Apple Inc	57.444.170
189.917	Microsoft Corp	53.966.946
10.114	Amazon.com Inc	26.371.023
8.047	Alphabet Inc	20.447.094
7.239	Alphabet Inc - Class A	18.824.364
17.380	Tesla Inc	15.369.803
60.742	Meta Platforms Inc - Class A	14.292.480
23.977	UnitedHealth Group Inc	11.594.556
51.144	NVIDIA Corp	11.233.682
77.076	JPMorgan Chase & Co	10.718.008
33.980	Berkshire Hathaway Inc - Class B	10.499.869
242.683	Bank of America Corp	9.760.843
56.144	Johnson & Johnson	9.735.114
42.633	Visa Inc - Class A	9.029.926
27.867	Home Depot Inc/The	8.995.176
95.919	NextEra Energy Inc	8.801.245
52.265	Procter & Gamble Co/The	8.067.890
21.934	Mastercard Inc	7.660.063
44.772	AbbVie Inc	6.341.122
119.121	Pfizer Inc	6.168.601

## L&G Clean Energy UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
2.118.802	Aker Solutions ASA	5.477.042
144.421	ERG SpA	4.580.115
558.954	Subsea 7 SA	4.571.399
105.496	Enbridge Inc	4.394.259
413.701	Peab AB	4.362.491
307.617	Array Technologies Inc	4.307.438
25.191	Schneider Electric SE	4.259.184
604.430	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	4.157.792
464.185	Falck Renewables SpA	4.155.077
366.584	Iberdrola SA	4.082.321
341.377	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	4.058.635
226.678	TPI Composites Inc	3.898.869
20.948	Acciona SA	3.860.265
580.942	ReneSola Ltd ADR	3.769.624
141.645	EDP Renovaveis SA	3.564.947
337.423	American Superconductor Corp	3.508.303
182.856	Azure Power Global Ltd	3.437.354
84.704	West Holdings Corp	3.410.902
2.368.407	Saipem SpA	3.375.596
72.868	SMA Solar Technology AG	3.271.030
90.615	Mitsubishi Corp	3.247.063
80.995	Toyota Tsusho Corp	3.244.252
203.156	Scatec ASA '144A'	3.233.859
2.332.985	China Steel Corp	3.145.673
7.328	Samsung SDI Co Ltd	3.133.699
159.569	Yokogawa Electric Corp	2.858.310
3.085	Tesla Inc	2.849.652
144.543	Encavis AG	2.844.462
160.803	Nordex SE	2.833.424
2.958.671	Centrica Plc	2.779.770
254.856	Fugro NV	2.710.997
56.181	ANDRITZ AG	2.695.025
35.926	Ormat Technologies Inc	2.693.583
127.456	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	2.687.993
14.000	Enphase Energy Inc	2.683.702
303.100	Worley Ltd	2.678.447
30.312	Energiekontor AG	2.662.392
60.501	Neoen SA '144A'	2.547.695
8.149	SolarEdge Technologies Inc	2.547.208
34.954	Ameresco Inc - Class A	2.546.989
72.582	Canadian Solar Inc	2.530.460
201.249	Sumitomo Electric Industries Ltd	2.507.950
72.359	Greenergy Renovables SA	2.480.502

## L&G Clean Energy UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
76.556	Vestas Wind Systems A/S	2.455.229
24.379	Alfen Beheer BV '144A'	2.450.736
28.048	First Solar Inc	2.437.404
180.122	Engie SA	2.402.203
194.565	Mitsubishi Electric Corp	2.397.617
353.821	Hitachi Zosen Corp	2.374.975
18.368	WSP Global Inc	2.364.979
67.686	Valmet Oyj	2.335.766
28.130	NextEra Energy Inc	2.313.758
18.370	Orsted AS '144A'	2.311.634
40.941	Atlas Copco AB	2.311.420
1.540.140	CTCI Corp	2.309.448
75.346	Boralex Inc	2.297.502
255.718	Delta Electronics Inc	2.288.400
192.847	E.ON SE	2.281.985
93.211	Sumitomo Heavy Industries Ltd	2.275.456
548.683	Downer EDI Ltd	2.255.251
69.507	Northland Power Inc	2.227.352
56.066	Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	2.208.259
38.698	CS Wind Corp	2.041.239

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
464.185	Falck Renewables SpA	4.363.511
82.077	Fuji Electric Co Ltd	4.083.576
1.142.139	Aker Solutions ASA	3.726.715
179.426	Covanta Holding Corp	3.627.346
100.011	Solarpack Corp Tecnologica SA	3.093.288
2.890.846	Teco Electric and Machinery Co Ltd	3.043.016
147.434	GS Yuasa Corp	2.913.364
2.685	Tesla Inc	2.484.191
2.405.190	Centrica Plc	2.377.187
31.683	Ameresco Inc - Class A	2.293.768
51.400	Toyota Tsusho Corp	2.273.865
85.446	Volitalia SA	2.226.881
195.903	Metso Outotec Oyj	2.016.588
15.125	WSP Global Inc	1.980.704
58.200	Taisei Corp	1.954.741
133.060	Eolus Vind AB	1.721.697
5.422	SolarEdge Technologies Inc	1.686.782
193.456	Worley Ltd	1.659.815

## L&G Clean Energy UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
8.073	Enphase Energy Inc	1.618.831
14.402	Alfen Beheer BV '144A'	1.589.706
36.645	Enbridge Inc	1.548.063
480.801	Sunworks Inc	1.530.835
68.325	SunPower Corp	1.495.840
17.254	NextEra Energy Inc	1.438.539
115.487	E.ON SE	1.410.067
153.468	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	1.328.251
164.861	Subsea 7 SA	1.326.314
16.971	Ormat Technologies Inc	1.321.436
19.769	Energiekontor AG	1.313.146
65.004	Azure Power Global Ltd	1.276.845
70.716	Yokogawa Electric Corp	1.268.573
37.451	ERG SpA	1.232.687
28.249	Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	1.204.266
880.534	CTCI Corp	1.196.731
11.516	First Solar Inc	1.166.880
135.324	PNE AG	1.134.274
32.334	Northland Power Inc	1.025.051
56.884	Nordex SE	979.002
18.837	ANDRITZ AG	974.796
25.210	Valmet Oyj	970.971
106.377	Delta Electronics Inc	960.274

## L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten £
1.792.000	DNB Bank ASA FRN	2,63 %	10.06.2026	1.780.614
813.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN'	4,87 %	06.05.2026	896.466
900.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,13 %	11.02.2027	869.922
850.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,25 %	12.02.2027	867.408
900.000	OP Corporate Bank plc 'GMTN'	1,38 %	04.09.2026	847.072
850.000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	834.377
830.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	820.506
700.000	AT&T Inc	2,90 %	04.12.2026	728.989
700.000	HSBC Holdings Plc FRN	2,26 %	13.11.2026	683.416
670.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN'	2,88 %	05.04.2027	656.959
600.000	Unilever Plc	1,50 %	22.07.2026	625.593
564.000	Rothesay Life Plc	3,38 %	12.07.2026	603.723
600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,00 %	16.07.2026	587.591
600.000	Banco Santander SA 'EMTN'	1,75 %	17.02.2027	568.202
550.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN	2,88 %	19.09.2026	567.079
600.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN	1,50 %	03.12.2026	557.446
500.000	Barclays Plc 'EMTN'	3,00 %	08.05.2026	538.093
550.000	Citigroup Inc	1,75 %	23.10.2026	532.382
483.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	3,50 %	30.09.2026	521.105
500.000	Land Securities Capital Markets Plc 'EMTN'	2,38 %	29.03.2027	494.910
410.000	Amgen Inc	5,50 %	07.12.2026	480.725
400.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN'	6,75 %	03.12.2026	479.296
430.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN'	3,50 %	18.12.2026	470.209
400.000	Scentre Group Trust 1 'EMTN'	3,88 %	16.07.2026	448.303
420.000	United Kingdom Gilt	2,75 %	07.09.2024	445.610
430.000	Diageo Finance Plc 'EMTN'	1,75 %	12.10.2026	441.861
430.000	New York Life Global Funding 'GMTN'	1,25 %	17.12.2026	423.386
400.000	Western Power Distribution Plc	3,63 %	06.11.2023	421.072
420.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2023	416.283
400.000	Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN	3,13 %	22.06.2025	414.204
409.000	InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN'	2,13 %	24.08.2026	413.717
400.000	Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN'	4,13 %	20.07.2022	411.395
411.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' FRN	3,47 %	26.04.2028	411.000

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
850.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 'EMTN'	2,38 %	08.04.2022	852.320
770.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN'	2,25 %	23.03.2022	770.849
760.000	HSBC Holdings PLC FRN	2,18 %	27.06.2023	760.000
700.000	Friends Life Holdings Plc	8,25 %	21.04.2022	708.668
660.000	BUPA Finance PLC	5,00 %	25.04.2023	701.691
696.000	DNB Bank ASA FRN	2,63 %	10.06.2026	694.399

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
650.000	Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN'	4,13 %	20.07.2022	653.934
640.000	Wells Fargo & Co 'EMTN'	1,38 %	30.06.2022	640.959
600.000	Unilever PLC	1,50 %	22.07.2026	615.743
560.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN'	1,63 %	18.06.2022	561.053
520.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN'	6,50 %	08.04.2022	528.450
500.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	1,38 %	07.06.2022	502.814
500.000	Henkel AG & Co KGaA	1,00 %	30.09.2022	498.710
500.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN'	1,63 %	15.12.2023	498.465
500.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	1,38 %	16.01.2025	489.933
488.000	Henkel AG & Co KGaA 'EMTN'	0,88 %	13.09.2022	486.751
470.000	Cooperatieve Rabobank UA	4,00 %	19.09.2022	471.718
470.000	BMW Finance NV 'EMTN'	0,88 %	16.08.2022	468.673
420.000	United Kingdom Gilt	2,75 %	07.09.2024	440.454
400.000	Scentre Group Trust 1 'EMTN'	3,88 %	16.07.2026	437.432
430.000	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,00 %	14.06.2022	430.004
400.000	Scottish Widows Ltd	5,50 %	16.06.2023	424.064
420.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2023	416.340
400.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN'	2,25 %	16.10.2024	413.614
410.000	BNP Paribas SA 'EMTN'	1,13 %	16.08.2022	409.330
330.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'	9,75 %	30.07.2024	408.843
400.000	United Utilities Water Ltd 'EMTN'	5,75 %	25.03.2022	408.290
400.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN	2,00 %	24.05.2031	404.284
400.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN'	2,75 %	05.12.2022	404.140
400.000	Mercedes-Benz International Finance BV 'EMTN'	2,00 %	04.09.2023	400.352
390.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN'	2,38 %	18.01.2022	390.421
400.000	OP Corporate Bank plc 'GMTN'	1,38 %	04.09.2026	390.352
400.000	Royal Bank of Canada 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	384.005
370.000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,38 %	29.12.2021	371.558
380.000	BMW International Investment BV 'EMTN'	0,75 %	08.03.2024	368.301
350.000	Telefonica Emisiones SA 'EMTN'	5,29 %	09.12.2022	361.965
320.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN'	1,38 %	27.06.2022	323.000
320.000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd	3,00 %	27.05.2022	321.875
320.000	Fidelity National Information Services Inc	1,70 %	30.06.2022	320.783
300.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN'	4,25 %	09.10.2025	312.609
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,38 %	20.12.2021	301.013
300.000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	1,13 %	15.12.2021	300.753
280.000	BMW International Investment BV 'EMTN'	1,88 %	11.09.2023	278.063

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten £
706.000	DNB Bank ASA FRN	2,63 %	10.06.2026	699.555
600.000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	588.344
600.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' FRN	2,00 %	12.04.2028	571.950
500.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN'	3,50 %	18.12.2026	553.199
500.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN'	4,87 %	06.05.2026	541.716
420.000	Western Power Distribution West Midlands Plc 'EMTN'	5,75 %	16.04.2032	529.364
341.000	Centrica Plc 'EMTN'	7,00 %	19.09.2033	509.028
400.000	SSE Plc 'EMTN'	8,38 %	20.11.2028	495.520
500.000	American Honda Finance Corp	0,75 %	25.11.2026	486.033
300.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'	5,25 %	10.04.2042	414.542
384.000	Rothsay Life Plc	3,38 %	12.07.2026	404.510
450.000	Metropolitan Life Global Funding I	0,63 %	08.12.2027	404.415
357.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,00 %	19.06.2025	392.300
300.000	M&G Plc FRN	6,25 %	20.10.2068	386.415
400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	1,00 %	16.07.2026	380.546
400.000	Banco Santander SA 'EMTN' FRN	2,25 %	04.10.2032	373.483
300.000	Severn Trent Utilities Finance Plc	6,25 %	07.06.2029	363.128
364.000	NatWest Group Plc 'EMTN' FRN	3,62 %	29.03.2029	362.709
300.000	BPCE SA	5,25 %	16.04.2029	354.707
350.000	Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN'	2,88 %	05.04.2027	340.118

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
470000	American Honda Finance Corp	0,75 %	25.11.2026	440.725
410000	HSBC Holdings Plc FRN	2,18 %	27.06.2023	410.034
200000	THFC Funding No 2 Plc 'EMTN'	6,35 %	08.07.2039	321.033
300000	Metropolitan Life Global Funding I 'GMTN'	2,63 %	05.12.2022	300.045
300000	Fiserv Inc	3,00 %	01.07.2031	297.884
200000	Orange SA 'EMTN'	8,13 %	20.11.2028	278.860
210000	University of Oxford	2,54 %	08.12.2117	257.626
253000	DNB Bank ASA FRN	2,63 %	10.06.2026	252.418
200000	Goldman Sachs Group Inc/The 'GMTN'	7,25 %	10.04.2028	249.611
225000	Wellcome Trust Ltd/The	1,50 %	14.07.2071	235.796
200000	RSA Insurance Group Ltd FRN	5,13 %	10.10.2045	228.890
210000	NGG Finance Plc FRN	5,63 %	18.06.2073	228.113
120000	Wellcome Trust Ltd/The	4,00 %	09.05.2059	216.799
200000	BUPA Finance Plc	5,00 %	08.12.2026	216.564
210000	Aroundtown SA 'EMTN'	3,63 %	10.04.2031	214.242
200000	Friends Life Holdings Plc	8,25 %	21.04.2022	208.458
200000	RAC Bond Co Plc 'EMTN'	4,87 %	06.05.2026	205.485
200000	Toyota Motor Finance Netherlands BV 'EMTN'	1,38 %	23.05.2023	203.812

## L&amp;G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
200000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'	4,00 %	19.06.2025	203.496
150000	Centrica Plc 'EMTN'	7,00 %	19.09.2033	203.312
200000	Fidelity National Information Services Inc	3,36 %	21.05.2031	202.930
200000	Aviva Plc FRN (Perpetual)	6,13 %	29.09.2170	202.000
200000	National Australia Bank Ltd 'GMTN'	1,38 %	27.06.2022	201.890
200000	United Kingdom Gilt	0,75 %	22.07.2023	201.518
200000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	1,38 %	07.06.2022	200.588
200000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'	1,00 %	14.06.2022	200.136
200000	New York Life Global Funding 'GMTN'	1,75 %	15.12.2022	199.358
200000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	1,38 %	16.01.2025	194.851
200000	Bank of Montreal 'EMTN'	1,00 %	09.09.2026	186.034
200000	Comcast Corp	1,88 %	20.02.2036	183.028
130000	Wellcome Trust Ltd/The	2,52 %	07.02.2118	179.958
200000	Metropolitan Life Global Funding I	0,63 %	08.12.2027	179.718
170000	Cooperatieve Rabobank UA	4,00 %	19.09.2022	171.945
170000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN'	2,25 %	23.03.2022	171.112
100000	Sanctuary Capital Plc	6,70 %	23.03.2039	168.147

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
2.150.000	Kuwait International Government Bond 'REGS'	3,50 %	20.03.2027	2.213.699
1.140.000	Hungary Government International Bond	5,75 %	22.11.2023	1.203.371
1.055.000	Uruguay Government International Bond	4,38 %	27.10.2027	1.165.359
1.080.000	Republic of Poland Government International Bond	3,25 %	06.04.2026	1.117.976
1.050.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	3,25 %	26.10.2026	1.102.890
1.020.000	Republic of Poland Government International Bond	4,00 %	22.01.2024	1.055.476
1.000.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	5,75 %	29.05.2024	993.420
880.000	Jamaica Government International Bond	6,75 %	28.04.2028	950.810
870.000	Croatia Government International Bond 'REGS'	6,00 %	26.01.2024	915.374
880.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	4,38 %	22.08.2023	900.063
800.000	Republic of South Africa Government International Bond	5,88 %	16.09.2025	847.785
820.000	Republic of Poland Government International Bond	3,00 %	17.03.2023	829.743
710.000	Dominican Republic International Bond 'REGS'	5,95 %	25.01.2027	765.360
725.000	Trinidad & Tobago Government International Bond 'REGS'	4,50 %	04.08.2026	746.834
600.000	Peruvian Government International Bond	7,35 %	21.07.2025	692.776
680.000	Hungary Government International Bond	5,38 %	21.02.2023	691.248
650.000	Republic of Azerbaijan International Bond 'REGS'	4,75 %	18.03.2024	665.338
600.000	Qatar Government International Bond 'REGS'	3,25 %	02.06.2026	640.768
600.000	Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS'	5,93 %	31.10.2025	640.250
650.000	CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS'	4,50 %	30.03.2027	636.313

## L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
950.000	Hungary Government International Bond	5,38 %	21.02.2023	969.810
806.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	6,75 %	07.02.2022	818.823
740.000	Hungary Government International Bond	5,75 %	22.11.2023	761.074
740.000	KSA Sukuk Ltd 'REGS'	2,89 %	20.04.2022	743.345
650.000	Oman Government International Bond 'REGS'	4,13 %	17.01.2023	659.885
600.000	Slovakia Government International Bond 'REGS'	4,38 %	21.05.2022	607.170
600.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'	2,50 %	11.10.2022	606.593
600.000	Oman Government International Bond 'REGS'	3,88 %	08.03.2022	605.352
600.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS'	4,13 %	10.12.2022	603.160
525.000	Trinidad Petroleum Holdings Ltd 'REGS'	9,75 %	15.06.2026	561.624
550.000	Colombia Government International Bond	4,00 %	26.02.2024	551.375
420.000	Petronas Capital Ltd 'REGS'	3,50 %	18.03.2025	455.242
445.000	Republic of Poland Government International Bond	5,00 %	23.03.2022	451.101
400.000	Gabon Government International Bond 'REGS'	6,38 %	12.12.2024	427.394
400.000	Lithuania Government International Bond 'REGS'	6,63 %	01.02.2022	408.040
400.000	Bolivian Government International Bond 'REGS'	5,95 %	22.08.2023	405.200
300.000	Power Sector Assets & Liabilities Management Corp 'REGS'	7,39 %	02.12.2024	354.271
275.000	Southern Gas Corridor CJSC 'REGS'	6,88 %	24.03.2026	327.113
1.050.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS'	0,00 %	28.06.2024	309.750
300.000	DAE Funding LLC 'REGS'	5,00 %	01.08.2024	307.500
300.000	Republic of South Africa Government International Bond	5,88 %	30.05.2022	304.870
300.000	Egypt Government International Bond 'REGS'	6,13 %	31.01.2022	302.610
300.000	Banco del Estado de Chile 'REGS'	3,88 %	08.02.2022	301.920
300.000	Saudi Government International Bond 'REGS'	2,88 %	04.03.2023	301.125
300.000	Republic of Azerbaijan International Bond 'REGS'	4,75 %	18.03.2024	294.810
275.000	Turkey Government International Bond	7,38 %	05.02.2025	286.990
250.000	Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS'	5,93 %	31.10.2025	275.975
250.000	Romanian Government International Bond 'REGS'	4,88 %	22.01.2024	261.750
250.000	Vietnam Government International Bond 'REGS'	4,80 %	19.11.2024	256.625
240.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic 'EMTN'	4,75 %	13.03.2023	255.254

## L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
42.900.000	China Government Bond	3,02	27.05.2031	6.738.634
43.200.000	China Government Bond	2,69	12.08.2026	6.722.611
30.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,85	06.01.2027	4.804.361
26.800.000	China Government Bond	2,47	02.09.2024	4.204.970
26.000.000	China Government Bond	3,01	13.05.2028	4.061.731
21.500.000	China Government Bond	2,91	14.10.2028	3.389.027
20.400.000	China Government Bond	2,75	17.02.2032	3.145.634
18.700.000	China Government Bond	2,89	18.11.2031	2.974.279
18.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,52	24.05.2031	2.831.411
17.500.000	China Development Bank	3,12	13.09.2031	2.728.034
18.000.000	China Government Bond	2,80	24.03.2029	2.689.518
16.500.000	China Government Bond	2,84	08.04.2024	2.585.925
17.100.000	China Government Bond	2,26	24.02.2025	2.542.363
16.000.000	China Development Bank	3,41	07.06.2031	2.516.475
16.000.000	China Government Bond	3,03	11.03.2026	2.513.312
16.000.000	China Government Bond	2,37	20.01.2027	2.468.998
14.500.000	Agricultural Development Bank of China	2,78	21.07.2024	2.234.047
13.700.000	Agricultural Development Bank of China	3,30	05.11.2031	2.157.310
13.000.000	China Government Bond	3,27	19.11.2030	2.063.534
12.600.000	China Development Bank	3,70	20.10.2030	2.025.732
12.400.000	China Development Bank	3,00	17.01.2032	1.919.175
11.500.000	China Government Bond	4,13	18.09.2024	1.882.027
12.000.000	China Government Bond	2,99	15.10.2025	1.871.094
11.500.000	Export-Import Bank of China/The	3,38	16.07.2031	1.810.225
12.000.000	China Government Bond	1,99	09.04.2025	1.799.527
10.000.000	China Government Bond	2,94	17.10.2024	1.563.223
10.500.000	China Government Bond	2,48	15.04.2027	1.558.626
9.500.000	China Government Bond	3,52	04.05.2027	1.550.513
9.500.000	Agricultural Development Bank of China	3,37	26.02.2026	1.486.111
9.500.000	China Development Bank	3,34	14.07.2025	1.470.294
9.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,79	26.10.2030	1.442.952

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
44.700.000	China Government Bond	2,75	08.08.2022	7.042.782
41.000.000	China Government Bond	2,68	21.05.2030	6.274.370
37.600.000	China Government Bond	3,02	27.05.2031	5.907.454
34.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,85	06.01.2027	5.460.908
34.000.000	China Government Bond	2,88	05.11.2023	5.349.584
33.000.000	China Government Bond	3,28	03.12.2027	5.299.429
33.000.000	China Government Bond	2,85	04.06.2027	5.136.254
31.000.000	China Government Bond	3,02	22.10.2025	4.909.553
32.000.000	China Government Bond	1,99	09.04.2025	4.892.945
30.000.000	China Government Bond	3,12	05.12.2026	4.792.910
27.500.000	China Government Bond	3,27	19.11.2030	4.450.899

## L&amp;G ESG China CNY Bond UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
27.500.000	China Government Bond	3,29	23.05.2029	4.410.460
27.200.000	China Government Bond	3,03	11.03.2026	4.291.856
27.000.000	China Government Bond	2,84	08.04.2024	4.242.911
25.000.000	China Government Bond	2,36	02.07.2023	3.899.490
24.750.000	China Government Bond	2,69	07.03.2022	3.839.913
24.000.000	China Government Bond	3,47	13.07.2022	3.794.591
24.000.000	China Government Bond	2,94	17.10.2024	3.773.561
24.200.000	China Government Bond	2,24	05.03.2023	3.762.739
22.000.000	Agricultural Development Bank of China	3,75	25.01.2029	3.553.751
21.000.000	China Government Bond	3,25	22.11.2028	3.356.790
21.000.000	China Government Bond	3,22	06.12.2025	3.321.068
21.000.000	China Government Bond	3,13	13.04.2022	3.290.955
20.000.000	China Government Bond	3,25	06.06.2026	3.212.935
20.100.000	China Government Bond	3,05	22.10.2022	3.183.573
20.000.000	China Government Bond	3,29	18.10.2023	3.161.431

## L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten £
3.012.000	United Kingdom Gilt	1,50 %	22.07.2026	3.150.566
2.270.000	United Kingdom Gilt	0,38 %	22.10.2026	2.196.998
1.202.000	United Kingdom Gilt	0,25 %	31.01.2025	1.178.229
890.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2024	873.788
833.000	United Kingdom Gilt	0,75 %	22.07.2023	830.839
775.000	United Kingdom Gilt 'REGS'	2,00 %	07.09.2025	792.606
810.000	United Kingdom Gilt	0,63 %	07.06.2025	792.354
721.000	United Kingdom Gilt	2,25 %	07.09.2023	729.124
689.000	United Kingdom Gilt	2,75 %	07.09.2024	712.166
708.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2023	702.676
670.000	United Kingdom Gilt	1,75 %	07.09.2022	676.429
693.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	30.01.2026	663.518
534.000	United Kingdom Gilt	5,00 %	07.03.2025	587.661
573.000	United Kingdom Gilt	1,00 %	22.04.2024	567.759
315.000	United Kingdom Gilt	0,50 %	22.07.2022	315.191

Vorstehend aufgeführt sind alle Käufe im Geschäftsjahr.

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
2.370.000	United Kingdom Gilt	1,75 %	07.09.2022	2.382.010
2.180.000	United Kingdom Gilt	4,00 %	07.03.2022	2.206.338
2.035.000	United Kingdom Gilt	0,50 %	22.07.2022	2.035.391
1.410.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2024	1.387.813
1.373.000	United Kingdom Gilt	0,75 %	22.07.2023	1.373.354
1.374.000	United Kingdom Gilt	0,63 %	07.06.2025	1.350.613
1.267.000	United Kingdom Gilt 'REGS'	2,00 %	07.09.2025	1.298.543
1.202.000	United Kingdom Gilt	2,75 %	07.09.2024	1.252.689
1.067.000	United Kingdom Gilt	2,25 %	07.09.2023	1.079.044
1.048.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	31.01.2023	1.039.090
1.039.000	United Kingdom Gilt	0,13 %	30.01.2026	989.388
935.000	United Kingdom Gilt	1,50 %	22.07.2026	929.107
917.000	United Kingdom Gilt	1,00 %	22.04.2024	907.726
815.000	United Kingdom Gilt	5,00 %	07.03.2025	892.890
693.000	United Kingdom Gilt	0,38 %	22.10.2026	652.727
205.000	United Kingdom Gilt	0,25 %	31.01.2025	196.900
165.000	United Kingdom Gilt	3,75 %	07.09.2021	165.602

Vorstehend aufgeführt sind alle Verkäufe im Geschäftsjahr.

## L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
500.000	Danske Bank A/S '144A'	1,23 %	22.06.2024	471.214
333.000	Broadcom Inc '144A'	4,93 %	15.05.2037	376.311
330.000	Salesforce Inc	2,90 %	15.07.2051	345.642
300.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd '144A'	2,55 %	10.03.2025	290.705
250.000	Cooperatieve Rabobank UA '144A'	2,63 %	22.07.2024	258.945
250.000	BPCE SA '144A'	1,00 %	20.01.2026	245.958
200.000	Morgan Stanley	6,38 %	24.07.2042	234.141
200.000	BNP Paribas SA '144A'	4,40 %	14.08.2028	226.480
200.000	HSBC Holdings Plc FRN	4,58 %	19.06.2029	224.158
200.000	Nippon Life Insurance Co '144A' FRN	4,70 %	20.01.2046	223.084
200.000	BPCE SA '144A'	5,15 %	21.07.2024	218.160
200.000	NatWest Group Plc	4,80 %	05.04.2026	217.932
200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A'	3,75 %	20.07.2023	210.348
200.000	Bank of America Corp FRN	3,00 %	20.12.2023	204.374
200.000	Citigroup Inc FRN	3,98 %	20.03.2030	202.951
200.000	HSBC Holdings Plc FRN	1,65 %	18.04.2026	201.660
170.000	Applied Materials Inc	5,10 %	01.10.2035	201.595
200.000	Nomura Holdings Inc	2,17 %	14.07.2028	200.404
200.000	BNP Paribas SA '144A' FRN	4,71 %	10.01.2025	200.302
200.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	3,30 %	30.01.2032	199.832

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
250.000	Credit Suisse Group AG	4,88 %	15.05.2045	318.506
250.000	PNC Bank NA 'BKNT'	4,20 %	01.11.2025	279.988
250.000	Mizuho Financial Group Inc FRN	1,12 %	28.02.2022	250.461
225.000	Prudential PLC 'EMTN' (Perpetual)	4,88 %	20.01.2171	229.343
225.000	Lennar Corp	4,13 %	15.01.2022	226.996
225.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN	0,91 %	31.10.2022	225.114
200.000	Sky Ltd '144A'	3,75 %	16.09.2024	218.726
200.000	BNP Paribas SA 'GMTN'	4,25 %	15.10.2024	216.910
225.000	Pacific Gas and Electric Co	2,95 %	01.03.2026	214.470
200.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'GMTN' FRN	1,89 %	28.10.2027	209.071
200.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV '144A'	2,25 %	19.09.2024	209.044
200.000	UBS Group AG '144A'	4,25 %	23.03.2028	207.805
200.000	Union Pacific Corp	2,38 %	20.05.2031	204.552
200.000	Diageo Capital PLC	2,13 %	24.10.2024	198.065
200.000	ING Groep NV FRN	2,73 %	01.04.2032	183.963
160.000	Broadcom Inc	4,11 %	15.09.2028	180.125

**L&G ESG USD Corporate Bond UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
159.000	Howmet Aerospace Inc	5,13 %	01.10.2024	175.504
150.000	Morgan Stanley	6,38 %	24.07.2042	173.434
172.000	Eaton Corp	2,75 %	02.11.2022	172.518
167.000	Gilead Sciences Inc	4,40 %	01.12.2021	167.983

## L&G ESG Emerging Markets Corporate Bond (USD) UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
5.500.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd/The 'EMTN'	2,25 %	15.07.2031	5.220.626
4.936.000	MAF Global Securities Ltd	4,75 %	07.05.2024	5.169.731
4.500.000	Petrobras Global Finance BV	7,38 %	17.01.2027	5.098.186
4.831.000	Perusahaan Gas Negara Tbk PT 'REGS'	5,13 %	16.05.2024	5.077.736
5.060.000	Altice Financing SA 'REGS'	5,75 %	15.08.2029	4.823.956
4.700.000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	3,50 %	16.01.2050	4.541.623
4.350.000	Banco Santander Chile 'REGS'	2,70 %	10.01.2025	4.362.234
4.530.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	2,63 %	31.03.2036	4.143.968
4.150.000	MC Brazil Downstream Trading SARL 'REGS'	7,25 %	30.06.2031	4.065.662
3.750.000	Petrobras Global Finance BV	5,60 %	03.01.2031	3.841.790
4.100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	3,15 %	01.10.2026	3.826.812
3.600.000	Sands China Ltd	5,40 %	08.08.2028	3.729.514
3.835.000	CK Hutchison International 19 II Ltd 'REGS'	3,38 %	06.09.2049	3.728.406
3.800.000	Seaspan Corp 'REGS'	5,50 %	01.08.2029	3.713.995
3.545.000	Formosa Group Cayman Ltd	3,38 %	22.04.2025	3.586.341
3.589.000	TSMC Arizona Corp	1,75 %	25.10.2026	3.551.046
3.420.000	Prudential Plc	3,13 %	14.04.2030	3.478.962
3.300.000	C&W Senior Financing DAC 'REGS'	6,88 %	15.09.2027	3.390.622
3.150.000	Flex Ltd	4,75 %	15.06.2025	3.377.031
3.400.000	Bank Hapoalim BM '144A' FRN	3,26 %	21.01.2032	3.344.663

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
4.250.000	Nanyang Commercial Bank Ltd FRN (Perpetual)	5,00 %	02.12.2170	4.256.370
3.600.000	Petrobras Global Finance BV	7,38 %	17.01.2027	4.050.431
4.225.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS'	2,63 %	31.03.2036	3.704.768
3.300.000	Perusahaan Gas Negara Tbk PT 'REGS'	5,13 %	16.05.2024	3.425.424
3.400.000	Petrobras Global Finance BV	5,60 %	03.01.2031	3.392.760
3.200.000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	3,50 %	16.01.2050	2.957.667
2.850.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS'	3,88 %	05.11.2023	2.938.202
2.700.000	Altice Financing SA 'REGS'	7,50 %	15.05.2026	2.805.510
2.550.000	Sands China Ltd	5,40 %	08.08.2028	2.748.989
3.000.000	Altice Financing SA 'REGS'	5,00 %	15.01.2028	2.681.238
2.500.000	REC Ltd 'REGS'	5,25 %	13.11.2023	2.560.997
2.492.000	CK Hutchison Capital Securities 17 Ltd 'REGS' FRN (Perpetual)	4,00 %	12.11.2170	2.499.554
2.100.000	Grupo Televisa SAB	6,63 %	18.03.2025	2.327.828
2.250.000	Africa Finance Corp 'REGS'	3,88 %	13.04.2024	2.242.125
2.150.000	CK Hutchison International 17 Ltd 'REGS'	3,50 %	05.04.2027	2.215.451
2.150.000	MAF Global Securities Ltd	4,75 %	07.05.2024	2.195.441
2.194.000	Prosus NV 'REGS'	4,85 %	06.07.2027	2.183.695
2.250.000	Banco do Brasil SA/Cayman 'REGS'	3,25 %	30.09.2026	2.150.994
2.300.000	RHB Bank Bhd 'EMTN'	1,66 %	29.06.2026	2.131.973
1.950.000	Sands China Ltd	4,60 %	08.08.2023	2.086.311

## L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
6.358.369	Hyzon Motors Inc	42.914.695
402.646	Xcel Energy Inc	26.636.705
629.791	Uniper SE	19.089.368
1.039.697	Bloom Energy Corp	18.737.431
2.018.615	Ballard Power Systems Inc	18.267.849
3.996.864	FuelCell Energy Inc	18.091.833
777.631	Siemens Energy AG	18.017.507
817.343	Plug Power Inc	17.804.002
1.697.918	Ceres Power Holdings Plc	17.101.520
10.158.881	NEL ASA	16.606.621
3.691.772	ITM Power Plc	16.502.208
9.365.779	Weichai Power Co Ltd 'H'	16.055.944
707.596	PowerCell Sweden AB	14.689.613
416.281	Doosan Fuel Cell Co Ltd	14.561.009
115.632	Orsted AS '144A'	14.403.653
473.164	Johnson Matthey Plc	14.234.438
84.380	Hyundai Motor Co	13.905.826
404.455	Chemours Co/The	13.007.077
564.362	McPhy Energy SA	12.854.862
57.981	Cummins Inc	12.734.497
605.400	Nippon Sanso Holdings Corp	12.612.127
72.537	Air Liquide SA	12.377.405
203.101	Kolon Industries Inc	12.276.403
563.300	Toyota Motor Corp	12.065.963
45.217	Air Products & Chemicals Inc	11.883.377
197.800	Kyocera Corp	11.674.565
35.434	Linde Plc	11.048.640
110.124	Mercedes-Benz Group AG	9.123.739
11.984.621	AFC Energy Plc	8.373.670
1.288.921	Cell Impact AB	5.949.504
159.549	SFC Energy AG	5.154.480
779.620	Advent Technologies Holdings Inc	4.896.122

## L&G Hydrogen Economy UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
402.646	Xcel Energy Inc	29.913.264
271.109	Mercedes-Benz Group AG	18.709.193
296.814	Plug Power Inc	13.065.360
260.363	Chemours Co/The	10.601.771
311.950	SFC Energy AG	10.222.179
4.462.475	Xebec Adsorption Inc	9.230.649
2.324.397	Cell Impact AB	9.076.959
513.042	McPhy Energy SA	8.812.959
15.076.424	AFC Energy Plc	8.291.116
2.003.627	Advent Technologies Holdings Inc	5.716.620
189.802	Bloom Energy Corp	5.615.996
83.453.483	Powerhouse Energy Group Plc	5.576.665
315.783	Toyota Motor Corp	5.545.771
99.009	Doosan Fuel Cell Co Ltd	4.288.003
24.587	Air Liquide SA	4.160.859
126.607	Daimler Truck Holding AG	3.771.733
11.239	Linde Plc	3.536.721
141.000	Nippon Sanso Holdings Corp	3.239.586
382.601	Hyzon Motors Inc	2.958.288
1.844.039	Cell Impact AB	2.826.932
40.414	Kolon Industries Inc	2.632.631
57.619	Uniper SE	2.449.798
378.036	ITM Power Plc	2.336.610

## L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten €
654.000	United Kingdom Gilt	0,88 %	31.07.2033	739.003
690.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A'	1,50 %	30.04.2045	656.793
560.000	European Union	0,40 %	04.02.2037	467.365
465.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2031	455.972
304.000	United Kingdom Gilt	1,50 %	31.07.2053	417.042
334.000	French Republic Government Bond OAT '144A'	1,75 %	25.06.2039	334.557
310.000	Spain Government Bond '144A'	1,00 %	30.07.2042	284.461
226.000	French Republic Government Bond OAT '144A'	0,50 %	25.06.2044	204.388
220.000	European Union	1,25 %	04.02.2043	203.172
200.000	FS Luxembourg Sarl 'REGS'	10,00 %	15.12.2025	183.602
200.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Singapore 'GMTN'	1,00 %	28.10.2024	173.529
170.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN'	0,00 %	15.09.2031	171.049
194.000	Greenko Dutch BV 'REGS'	3,85 %	29.03.2026	168.263
148.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2030	140.606
141.000	Bundesobligation	0,00 %	10.10.2025	139.717
100.000	CPI Property Group SA 'EMTN'	2,75 %	22.01.2028	120.835
100.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN'	1,75 %	30.09.2034	116.199
100.000	AB Ignitis Grupe 'EMTN'	1,88 %	10.07.2028	109.848
100.000	Gecina SA 'EMTN'	0,88 %	30.06.2036	104.280
100.000	Westpac Banking Corp FRN	0,77 %	13.05.2031	100.924
100.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN	0,80 %	05.07.2029	100.540
100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN	1,88 %	02.08.2081	100.430
100.000	de Volksbank NV 'EMTN'	0,38 %	03.03.2028	100.295
100.000	Citycon Oyj FRN (Perpetual)	3,63 %	10.09.2170	100.159
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'	0,25 %	29.06.2028	99.366
100.000	CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund	0,90 %	12.10.2029	98.948
115.000	Netherlands Government Bond '144A'	0,50 %	15.01.2040	97.413
100.000	Hong Kong Government International Bond 'GMTN'	0,00 %	24.11.2026	97.250
100.000	SBAB Bank AB 'EMTN'	0,50 %	08.02.2027	96.895
100.000	CTP NV 'EMTN'	0,50 %	21.06.2025	96.630
100.000	Bpifrance SACA 'EMTN'	0,00 %	25.05.2028	96.090
100.000	Segro Capital Sarl 'EMTN'	1,88 %	23.03.2030	95.596
100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN'	0,38 %	23.06.2029	94.255
100.000	Ontario Teachers' Finance Trust 'GMTN'	0,05 %	25.11.2030	93.021
100.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'	0,50 %	23.09.2029	93.017
100.000	Gecina SA 'EMTN'	0,88 %	25.01.2033	92.997
100.000	Societe Du Grand Paris EPIC 'EMTN'	0,88 %	10.05.2046	92.812
80.000	European Investment Bank 'EMTN'	0,75 %	15.11.2024	92.378
100.000	CaixaBank SA 'EMTN' FRN	1,25 %	18.06.2031	91.983
100.000	CTP NV 'EMTN'	1,25 %	21.06.2029	91.584

## L&amp;G ESG Green Bond UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse €
1.372.000	French Republic Government Bond OAT '144A'	1,75 %	25.06.2039	1.337.115
489.000	United Kingdom Gilt	0,88 %	31.07.2033	499.942
510.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2030	475.021
520.000	Netherlands Government Bond '144A'	0,50 %	15.01.2040	463.710
456.000	Bundesobligation	0,00 %	10.10.2025	451.553
457.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A'	1,25 %	22.04.2033	448.411
480.000	French Republic Government Bond OAT '144A'	0,50 %	25.06.2044	344.348
474.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A'	1,50 %	30.04.2045	338.409
302.000	Ireland Government Bond	1,35 %	18.03.2031	304.049
337.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2031	301.719
320.000	European Union	0,40 %	04.02.2037	243.165
312.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2050	234.895
240.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN'	0,00 %	15.09.2028	214.990
200.000	European Investment Bank 'EMTN'	1,25 %	13.11.2026	209.466
200.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN'	0,25 %	30.06.2025	203.740
204.000	United Kingdom Gilt	1,50 %	31.07.2053	194.685
200.000	FS Luxembourg Sarl 'REGS'	10,00 %	15.12.2025	193.278
200.000	MAF Sukuk Ltd	4,64 %	14.05.2029	192.043
200.000	European Investment Bank '144A'	2,88 %	13.06.2025	186.118
200.000	ReNew Power Pvt Ltd 'REGS'	6,45 %	27.09.2022	182.006

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten £
52.450	Rio Tinto Plc	2.859.668
4.844.731	Lloyds Banking Group Plc	2.298.189
853.275	Legal & General Group Plc	2.073.519
62.034	Anglo American Plc	1.787.449
66.446	Persimmon Plc	1.622.281
88.279	Intermediate Capital Group Plc	1.570.885
52.421	Admiral Group Plc	1.471.920
84.652	Imperial Brands Plc	1.415.502
86.810	GlaxoSmithKline Plc	1.368.656
125.994	United Utilities Group Plc	1.339.924
35.878	Diageo Plc	1.328.745
45.381	Severn Trent Plc	1.302.572
13.932	AstraZeneca Plc	1.266.554
40.675	British American Tobacco Plc	1.224.753
106.357	National Grid Plc	1.100.464
376.536	Abrdn Plc	958.927
154.704	BAE Systems Plc	951.688
106.094	IG Group Holdings Plc	835.496
63.680	Polymetal International Plc	809.879
416.587	BT Group Plc	729.649
8.282	Games Workshop Group Plc	701.040
35.436	Rathbones Group Plc	691.748
91.157	Tate & Lyle Plc	659.123
268.145	Man Group Plc/Jersey	581.131
41.060	Pennon Group Plc	468.505

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse £
1.112.137	BT Group Plc	1.961.450
25.424	Rio Tinto	1.409.986
654.875	Abrdn Plc	1.369.979
106.344	Pennon Group Plc	1.122.507
32.170	Bellway PLC	1.105.851
368.278	Legal & General Group Plc	1.031.126
142.455	Barratt Developments Plc	968.360
25.687	Imperial Brands Plc	452.999
29.741	Dunelm Group Plc	435.618
12.689	British American Tobacco Plc	413.902
22.836	Rathbones Group Plc	404.988
3.689	AstraZeneca Plc	370.141
20.964	GlaxoSmithKline Plc	342.319
42.891	BAE Systems Plc	322.807

**L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions UK UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Nominal	Bezeichnung	Erlöse £
6.049	Rio Tinto Plc	308.931
6.851	Diageo Plc	247.679
123.894	Polymetal International Plc	210.922
18.664	United Utilities Group Plc	194.943
7.724	Admiral Group Plc	190.823
17.560	National Grid Plc	177.858
267.056	Cineworld Group Plc	169.652
14.278	Bank of Georgia Group Plc	167.012
5.897	Severn Trent Plc	165.981
4.952	Anglo American Plc	162.379

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

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Nominal	Bezeichnung	Kosten €
7.959	OMV AG	396.288
9.311	Ageas SA/NV	395.813
37.885	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	376.447
30.432	ING Groep NV	355.143
18.814	DNB Bank ASA	354.982
4.910	KBC Group NV	351.374
6.389	BNP Paribas SA	348.999
30.207	Skandinaviska Enskilda Banken AB - Class A	314.634
18.404	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	309.399
6.703	TotalEnergies SE	307.737
15.645	Electrolux AB	301.460
7.239	Adecco Group AG	299.385
12.173	Societe Generale SA	295.780
11.986	Mowi ASA	251.358
9.629	Fortum Oyj	205.493
372	Swiss Life Holding AG	183.603
3.976	Holcim AG	179.176
9.830	Assicurazioni Generali SpA	177.693
5.249	Erste Group Bank AG	176.000
5.960	Rubis SCA	175.393
2.309	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	167.657
24.208	Terna - Rete Elettrica Nazionale	167.307
3.156	Elisa Oyj	166.942
12.174	Telenor ASA	166.422
70.642	Intesa Sanpaolo SpA	160.937
1.182	Siemens AG	160.253
3.047	Atlas Copco AB - Class A	159.898
7.220	Sandvik AB	151.174
2.763	Randstad NV	150.821
3.363	Sampo Oyj - Class A	150.201
1.043	Baloise Holding AG	150.125
1.364	Helvetia Holding AG	149.946
375	Zurich Insurance Group AG	146.104

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

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse €
9.019	ASR Nederland NV	371.797
68.527	Snam SpA	337.159
108.579	Koninklijke KPN NV	328.049
7.075	Ageas SA/NV	322.727
3.156	Bayerische Motoren Werke AG	253.603
6.567	Huhtamaki Oyj	245.078
3.392	Mercedes-Benz Group AG	242.041
27.755	Powszechny Zakład Ubezpieczeń SA	228.096
11.385	Endesa SA	207.424
373	Swiss Life Holding AG	191.586
5.868	Axfood AB	152.886
348	Zurich Insurance Group AG	138.742
34.270	Natixis SA	137.077
7.607	Assicurazioni Generali SpA	132.914
19.126	Terna - Rete Elettrica Nazionale	130.412
3.076	Boliden AB	129.926
10.733	Orange SA	116.401
8.253	Telenor ASA	109.701
606	Koninklijke DSM NV	104.335
329	Roche Holding AG	103.506
1.225	Porsche Automobil Holding SE - Preference	101.638
1.090	Sanofi	100.047
9.225	Nordea Bank Abp	99.869
659	Baloise Holding AG	99.493
1.879	Holcim AG	95.165
3.754	AXA SA	90.718
9.302	Euronav NV	90.630
600	Air Liquide SA	87.756
1.956	Sampo Oyj - Class A	85.489
4.725	UBS Group AG	81.720
3.063	Fortum Oyj	80.278
716	Helvetia Holding AG	79.768
4.264	Red Electrica Corp SA	74.059
482	Schneider Electric SE	73.831
2.875	TietoEVRY Oyj	71.275
1.354	Elisa Oyj	71.081
7.413	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	70.906

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
318.391	Alumina Ltd	480.229
7.692	Samsung Life Insurance Co Ltd	456.599
154.484	Singapore Technologies Engineering Ltd	437.649
18.579	DBS Group Holdings Ltd	429.348
79.644	Atlas Arteria Ltd	426.916
11.670	Mineral Resources Ltd	410.234
371.447	Lenovo Group Ltd	406.773
29.643	Venture Corp Ltd	405.110
9.975	Samsung Securities Co Ltd	398.337
136.234	Metcash Ltd	396.019
52.508	CK Hutchison Holdings Ltd	383.893
2.549	Kumho Petrochemical Co Ltd	333.256
42.076	BNK Financial Group Inc	290.952
10.900	United Overseas Bank Ltd	229.009
1.065	LG Chem Ltd - Preference	221.004
1.139	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	206.675
1.403	Macquarie Group Ltd	204.872
3.782	SK Telecom Co Ltd	195.451
69.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	184.464
14.047	Fortescue Metals Group Ltd	180.837
19.700	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	176.787
11.786	Magellan Financial Group Ltd	176.119
49.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	168.081
80.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	159.232
182.000	Want Want China Holdings Ltd	158.537
22.004	VTech Holdings Ltd	157.507
2.015	Rio Tinto Ltd	154.635
1.954	Hyundai Motor Co - Preference	152.380
21.635	APA Group	150.556
275	LG H&H Co Ltd - Preference	150.192
278.000	PCCW Ltd	147.662

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Asia Pacific ex-Japan UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
240.236	AusNet Services Ltd	439.056
229.719	Singapore Telecommunications Ltd	432.872
32.580	Transurban Group	336.010
46.490	Bank of Queensland Ltd	319.871
54.816	Infratil Ltd	310.439
51.000	MTR Corp Ltd	287.035
1.345	SK Innovation Co Ltd	274.076
37.260	Crown Resorts Ltd	257.720
14.200	Jardine Cycle & Carriage Ltd	244.885
244.000	Want Want China Holdings Ltd	241.938
207.600	ComfortDelGro Corp Ltd	237.011
10.700	United Overseas Bank Ltd	226.869
46.000	SITC International Holdings Co Ltd	192.088
5.233	GS Holdings Corp	191.276
9.585	Cheil Worldwide Inc	181.701
51.344	Pendal Group Ltd	181.596
1.252	Macquarie Group Ltd	180.623
72.000	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	149.522
153.000	NWS Holdings Ltd	144.728
3.053	SK Square Co Ltd	134.916
667	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	128.838
36.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	128.709
66.000	Sands China Ltd	127.574
14.200	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	122.209
2.548	KB Financial Group Inc	117.152
4.468	DBS Group Holdings Ltd	111.567
17.500	Power Assets Holdings Ltd	109.434
17.500	CK Infrastructure Holdings Ltd	109.378
60.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	108.127
32.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	108.019
2.767	Hana Financial Group Inc	106.368
946	Hyosung Corp	98.795
71.751	Alumina Ltd	98.199
13.229	APA Group	97.642
1.557	ASX Ltd	95.598
14.120	SeaLink Travel Group Ltd	90.579

## L&G Digital Payments UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
906	Shopify Inc - Class A	613.396
3.505	Block Inc	555.041
29.514	StoneCo Ltd - Class A	543.717
34.097	Zuora Inc	527.756
6.758	Nuvei Corp '144A'	522.551
64.892	Wise Plc - Class A	494.792
18.219	Pagseguro Digital Ltd - Class A	487.126
4.015	Coupa Software Inc	476.497
201	Adyen NV '144A'	476.338
16.137	Flywire Corp	470.384
3.084	PayPal Holdings Inc	466.931
47.272	GreenSky Inc	439.601
262.493	EML Payments Ltd	438.077
82.831	Paysafe Ltd	429.462
30.468	Marqeta Inc	425.761
3.590	GMO Payment Gateway Inc	423.018
19.280	I3 Verticals Inc - Class A	416.663
51.477	BTRS Holdings Inc	414.936
22.341	Repay Holdings Corp - Class A	405.888
10.051	Lightspeed Commerce Inc	397.804
367.843	Pushpay Holdings Ltd	390.646
9.054	Green Dot Corp - Class A	380.914
23.173	Nexi SpA '144A'	379.159
4.544	Afterpay Ltd	379.017
5.653	Worldline SA/France '144A'	370.577
2.139	American Express Co	366.219
42.224	Paya Holdings Inc	366.201
22.325	International Money Express Inc	360.288
4.646	Q2 Holdings Inc	359.774
7.777	EVERTEC Inc	351.440
797	Fair Isaac Corp	344.068
2.868	Discover Financial Services	342.426
959	Mastercard Inc	341.784
2.304	Global Payments Inc	341.473
1.543	Visa Inc - Class A	341.385
6.401	Edenred	338.981
79.244	Network International Holdings Plc '144A'	337.211
28.500	Credit Saison Co Ltd	333.080
91.236	Yeahka Ltd	332.412
17.273	OneSpan Inc	332.172
13.001	Evo Payments Inc - Class A	323.653
1.993	Kakaopay Corp	322.982
3.044	Fiserv Inc	321.364

## L&G Digital Payments UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
12.016	Dlocal Ltd/Uruguay - Class A	319.390
2.537	Euronet Worldwide Inc	313.871
5.038	Tencent Holdings Ltd	313.296
9.243	ACI Worldwide Inc	312.215
47.584	Payoneer Global Inc	310.504
2.517	Fidelity National Information Services Inc	306.810
31.898	QIWI plc ADR	287.903

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
71.943	GreenSky Inc	839.757
11.075	EVERTEC Inc	432.316
17.032	International Money Express Inc	305.815
95.536	Paysafe Ltd	242.154
12.105	Zuora Inc	238.080
47.584	Payoneer Global Inc	211.247
141	Shopify Inc - Class A	206.061
1.201	American Express Co	193.583
69	Adyen NV '144A'	188.705
1.792	Block Inc CDI	185.983
16.298	Credit Saison Co Ltd	181.200
517	Mastercard Inc	176.079
71.174	Boku Inc '144A'	162.111
1.244	GMO Payment Gateway Inc	161.577
166.902	Pushpay Holdings Ltd	157.386
765	Visa Inc - Class A	156.468
6.715	I3 Verticals Inc - Class A	156.176
1.383	Discover Financial Services	151.434
3.156	Edenred	144.684
352	Fair Isaac Corp	141.420
1.993	Kakaopay Corp	133.320
2.215	Nuvei Corp '144A'	132.138
1.335	Fiserv Inc	130.062
5.460	Evo Payments Inc - Class A	121.631
1.717	Afterpay Ltd	118.007
991	Euronet Worldwide Inc	108.164
36.833	EML Payments Ltd	89.760
719	Global Payments Inc	84.429
2.360	Green Dot Corp - Class A	83.724
434	Block Inc	78.685
631	Fidelity National Information Services Inc	61.704

## L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF\*

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
863.642.955	Barclays Bank Plc	1,69 %	22.07.2022	863.642.955
830.323.955	Barclays Bank Plc	1,03 %	22.06.2022	830.323.955
826.722.955	Barclays Bank Plc	1,69 %	22.07.2022	826.722.955
795.902.955	Barclays Bank Plc	1,69 %	22.07.2022	795.902.955
793.397.955	Barclays Bank Plc	0,69 %	24.05.2022	793.397.955
724.118.955	Barclays Bank Plc	0,50 %	22.04.2022	724.118.955
609.982.955	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.03.2022	609.982.955
602.738.955	Barclays Bank Plc	0,17 %	23.02.2022	602.738.955
542.559.955	Barclays Bank Plc	0,16 %	24.01.2022	542.559.955
381.351.000	Barclays Bank Plc	0,16 %	22.12.2021	381.351.000
109.499.000	Barclays Bank Plc	0,16 %	22.12.2021	109.499.000
45.131.955	Barclays Bank Plc	0,15 %	22.12.2021	45.131.955
44.530.000	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.03.2022	44.530.000
42.176.955	Barclays Bank Plc	0,15 %	22.12.2021	42.176.955
42.073.955	Barclays Bank Plc	0,15 %	23.11.2021	42.073.955
34.266.240	Barclays Bank Plc	0,14 %	22.10.2021	34.266.240
33.373.955	Barclays Bank Plc	0,15 %	23.11.2021	33.373.955
30.782.240	Barclays Bank Plc	0,15 %	22.09.2021	30.782.240
29.352.240	Barclays Bank Plc	0,15 %	22.09.2021	29.352.240
22.201.000	Barclays Bank Plc	0,81 %	24.05.2022	22.201.000

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
863.642.955	Barclays Bank Plc	1,69 %	22.07.2022	863.642.955
830.323.955	Barclays Bank Plc	1,03 %	22.06.2022	830.323.955
826.722.955	Barclays Bank Plc	1,69 %	22.07.2022	826.722.955
793.397.955	Barclays Bank Plc	0,69 %	24.05.2022	793.397.955
724.118.955	Barclays Bank Plc	0,50 %	22.04.2022	724.118.955
609.982.955	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.03.2022	609.982.955
602.738.955	Barclays Bank Plc	0,17 %	23.02.2022	602.738.955
542.559.955	Barclays Bank Plc	0,16 %	24.01.2022	542.559.955
381.351.000	Barclays Bank Plc	0,16 %	22.12.2021	381.351.000
109.499.000	Barclays Bank Plc	0,16 %	22.12.2021	109.499.000
45.131.955	Barclays Bank Plc	0,15 %	22.12.2021	45.131.955
44.530.000	Barclays Bank Plc	0,22 %	23.03.2022	44.530.000
42.176.955	Barclays Bank Plc	0,15 %	22.12.2021	42.176.955
42.073.955	Barclays Bank Plc	0,15 %	23.11.2021	42.073.955
34.266.240	Barclays Bank Plc	0,14 %	22.10.2021	34.266.242
33.373.955	Barclays Bank Plc	0,15 %	23.11.2021	33.373.955
30.782.240	Barclays Bank Plc	0,15 %	22.09.2021	30.782.240
29.352.240	Barclays Bank Plc	0,15 %	22.09.2021	29.352.240
22.201.000	Barclays Bank Plc	0,81 %	24.05.2022	22.201.000
21.483.260	Barclays Bank Plc	0,15 %	24.08.2021	21.483.260

\* Der Fonds wurde am 2. Juli 2021 aufgelegt

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF\*

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
99.657	iShares MSCI India UCITS ETF - ETF	707.240
260.700	Bank Mandiri Persero Tbk PT	124.594
64.000	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	105.383
19.945	Itau Unibanco Holding SA - Preference	104.850
46.444	United Microelectronics Corp	103.628
14.400	Anhui Conch Cement Co Ltd 'A'	101.079
126.200	China State Construction Engineering Corp Ltd 'A'	99.658
24.547	Hindustan Petroleum Corp Ltd	98.016
18.388	Bharat Petroleum Corp Ltd	97.505
60.371	Indian Oil Corp Ltd	97.177
31.200	SAIC Motor Corp Ltd 'A'	96.814
29.300	China Yangtze Power Co Ltd 'A'	96.213
36.200	Orbia Advance Corp SAB de CV	94.173
36.779	Power Grid Corp of India Ltd	94.127
35.500	CITIC Securities Co Ltd 'H'	93.240
45.258	GAIL India Ltd	93.135
1.281	Magnit PJSC	92.324
137.000	AUO Corp	92.224
28.306	ITC Ltd	91.749
143.100	Thai Union Group PCL	91.574

\* Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt

## L&G Quality Equity Dividends ESG Exclusions Emerging Markets UCITS ETF\*

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
99.657	iShares MSCI India UCITS ETF - ETF	786.265
32.000	E Ink Holdings Inc	132.142
12.198	Standard Bank Group Ltd	131.672
30.800	Banco Bradesco SA - Preference	124.021
70.596	China Merchants Port Holdings Co Ltd	124.020
200.000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	113.798
119.405	Xtrackers MSCI Pakistan Swap UCITS ETF - ETF	112.705
12.898	Riyad Bank	111.502
260.400	Krung Thai Bank PCL	109.204
43.000	Taiwan Fertilizer Co Ltd	106.091
40.927	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	105.324
8.438	Banque Saudi Fransi	104.153
33.450	Tung Ho Steel Enterprise Corp	98.169
37.300	Orbia Advance Corp SAB de CV	97.789
74.600	CIMB Group Holdings Bhd	96.553
10.063	Foschini Group Ltd/The	93.144
74.000	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	92.123
35.200	CCR SA	90.058
81.500	DiGi.Com Bhd	87.652
23.000	Taiwan Mobile Co Ltd	85.469

\* Der Fonds wurde am 12. Juli 2021 aufgelegt

## L&G India INR Government Bond UCITS ETF\*

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
1.885.500.000	India Government Bond	5,63 %	12.04.2026	24.871.615
1.934.500.000	India Government Bond	6,10 %	12.07.2031	24.762.709
1.701.700.000	India Government Bond	7,26 %	14.01.2029	23.586.262
1.868.000.000	India Government Bond	6,67 %	17.12.2050	23.351.463
1.621.000.000	India Government Bond	6,99 %	15.12.2051	20.618.156
1.618.100.000	India Government Bond	5,77 %	03.08.2030	20.491.598
1.514.200.000	India Government Bond	6,45 %	07.10.2029	20.068.665
1.520.000.000	India Government Bond	5,22 %	15.06.2025	20.020.519
1.529.700.000	India Government Bond	5,15 %	09.11.2025	19.971.818
1.557.200.000	India Government Bond	5,85 %	01.12.2030	19.797.613
1.323.500.000	India Government Bond	6,18 %	04.11.2024	18.040.484
1.412.400.000	India Government Bond	5,79 %	11.05.2030	17.930.497
1.301.000.000	India Government Bond	7,16 %	20.09.2050	17.427.847
1.098.500.000	India Government Bond	7,72 %	15.06.2049	15.705.879
1.113.000.000	India Government Bond	6,54 %	17.01.2032	13.940.162
856.200.000	India Government Bond	7,32 %	28.01.2024	11.915.223
935.000.000	India Government Bond	5,74 %	15.11.2026	11.877.695

Vorstehend aufgeführt sind alle Käufe im Geschäftsjahr.

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
526.000.000	India Government Bond	6,99 %	15.12.2051	6.804.102
177.000.000	India Government Bond	5,15 %	09.11.2025	2.118.148
165.000.000	India Government Bond	7,26 %	14.01.2029	2.097.536
107.000.000	India Government Bond	6,45 %	07.10.2029	1.323.420
95.000.000	India Government Bond	7,32 %	28.01.2024	1.230.526
69.000.000	India Government Bond	6,18 %	04.11.2024	889.611
75.000.000	India Government Bond	5,77 %	03.08.2030	887.250
70.000.000	India Government Bond	5,22 %	15.06.2025	864.448
60.000.000	India Government Bond	5,85 %	01.12.2030	698.566
40.000.000	India Government Bond	7,72 %	15.06.2049	521.545
42.000.000	India Government Bond	5,79 %	11.05.2030	488.779
40.000.000	India Government Bond	6,10 %	12.07.2031	471.371
30.000.000	India Government Bond	7,16 %	20.09.2050	366.651
6.000.000	India Government Bond	6,67 %	15.12.2035	78.965
4.000.000	India Government Bond	6,67 %	17.12.2050	50.271

Vorstehend aufgeführt sind alle Verkäufe im Geschäftsjahr.

\* Der Fonds wurde am 26. Oktober 2021 aufgelegt

