

Legal & General UCITS ETF Plc

Ungeprüfter Halbjahresbericht und Halbjahresabschluss
für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019

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



Inhalt

Legal & General UCITS ETF Plc Halbjahresbericht und ungeprüfter Halbjahresabschluss

| | |
|---|---|
| Inhaltsverzeichnis | 1 |
| Verwaltungsrat und sonstige Informationen | 2 |
| Informationen über die Gesellschaft | 4 |
| Fondsbericht | 9 |

Ungeprüfter Halbjahresabschluss der Gesellschaft

| | |
|---|----|
| Bilanz der Gesamtgesellschaft | 13 |
| Gesamtergebnisrechnung der Gesamtgesellschaft | 14 |
| Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens der Gesamtgesellschaft | 15 |
| Kapitalflussrechnung der Gesamtgesellschaft | 16 |

Ungeprüfter Halbjahresabschluss der Fonds

| | |
|--|----|
| Bilanz | |
| zum 31. Dezember 2019 | 17 |
| Vergleichsdaten zum 30. Juni 2019 | 21 |
| Gesamtergebnisrechnung | |
| für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | 26 |
| Vergleichsdaten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 | 30 |
| Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens | |
| für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | 34 |
| Vergleichsdaten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 | 36 |
| Anmerkungen zum Halbjahresabschluss | 38 |

Sonstige Informationen - ungeprüft

| | |
|---|-----|
| Aufstellung der Vermögenswerte | 84 |
| Weitere Informationen | 261 |
| Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften | 262 |
| Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe | 270 |

Verwaltungsrat und sonstige Informationen

Verwaltungsrat:

Mark Weeks (Brite) ⁽²⁾
Eimear Cowhey (Irin) ⁽¹⁾
Adrian Waters (Ire) ⁽¹⁾
Amy Ellison (Britin)
Feargal Dempsey (Ire) ⁽¹⁾
(am 14. Januar 2020 bestellt)

Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführend

⁽¹⁾ Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

⁽²⁾ Vorsitzender

Verwaltungsgesellschaft:

LGIM ETF Managers Limited
2 Grand Canal Square
Dublin 2
D02 A342
Irland

Anlageverwalter:

GO ETF Solutions LLP
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
(wirksam zum 1. Dezember 2019)
Riverside II, Sir John Rogerson's Quay
Grand Canal Dock
Dublin 2
D01 E4X0
Irland

BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited
(bis 30. November 2019)
One Dockland Central
Guild Street IFSC
Dublin 1
D01 E4X0
Irland

Registerstelle:

Computershare Investor Services (Ireland)
Limited
3100 Lake Drive
Citywest Business Campus
Dublin 24
D24 AK82
Irland

Listing Sponsor im Vereinigten Königreich:

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

Eingetragener Sitz:

2 Grand Canal Square
Dublin 2
D02 A342
Irland

Verwalter und Transferstelle:

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

Gesellschaftssekretär:

Wilton Secretarial Limited
2 Grand Canal Square
Dublin 2
D02 A342
Irland

Unabhängige Abschlussprüfer:

KPMG
1 Harbourmaster Place
International Financial Services Centre
Dublin 1
D01 F6F5
Irland

Rechtsberater in Irland:

William Fry
2 Grand Canal Square
Dublin 2
D02 A342
Irland

Verwaltungsrat und sonstige Informationen (Fortsetzung)

Vertriebsstelle:

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

Sicherheitenverwalter:

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

Registernummer: 459936

Dieser Halbjahresbericht und ungeprüfte Halbjahresabschluss (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 aufgetragenen 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 „Prospekt“) und im jeweiligen fondsspezifischen Prospektnachtrag (der „Nachtrag“) angegeben sind.

Zum 31. Dezember 2019 waren die folgenden 40 Fonds der Gesellschaft von der Zentralbank genehmigt, von denen 27 am Ende des Berichtszeitraums 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 |
|---|----------------------------------|---|
| L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF | Fonds mit physischer Nachbildung | MSCI China A Onshore Index |
| L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF | " | ROBO Global Robotics and Automation UCITS Index |
| L&G LOIM Euro Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ | " | LOIM Fundamental Euro Government Index |
| L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ² | " | LOIM Fundamental Euro Corporate Index |
| L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ² | " | LOIM Fundamental Global Corporate Index |
| L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF ² | " | LOIM Fundamental Global Government Index |
| L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF ² | " | LOIM Fundamental EM Local Currency Index |
| L&G Cyber Security UCITS ETF | " | ISE Cyber Security® UCITS Index Net Total Return |
| L&G Battery Value-Chain UCITS ETF | " | Solactive Battery Value-Chain Index Net Total Return |
| L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF | " | Solactive Pharma Breakthrough Value Index Net Total Return |
| L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF | " | Solactive eCommerce Logistics Index Net Total Return |
| L&G US Equity UCITS ETF | " | Solactive Core United States Large & Mid Cap Index NTR |
| L&G UK Equity UCITS ETF | " | Solactive Core United Kingdom Large & Mid Cap Index NTR |
| L&G Japan Equity UCITS ETF | " | Solactive Core Japan Large & Mid Cap USD Index NTR |
| L&G Global Equity UCITS ETF | " | Solactive Core Developed Markets Large & Mid Cap USD Index NTR |
| L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF | " | Solactive Core Developed Markets Europe ex UK Large & Mid Cap EUR Index NTR |

Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

| Name des Fonds | Fondsart | Indexname |
|---|----------|---|
| L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF | " | Solactive Core Developed Markets Pacific ex Japan Large & Mid Cap USD Index NTR |
| L&G Germany Equity UCITS ETF ³ | " | Solactive Core Germany Large & Mid Cap Index NTR |
| L&G Italy Equity UCITS ETF ³ | " | Solactive Core Italy Large & Mid Cap Index NTR |
| L&G Switzerland Equity UCITS ETF ³ | " | Solactive Core Switzerland Large & Mid Cap CHF Index NTR |
| L&G Clean Water UCITS ETF | " | Solactive Clean Water Index NTR |
| L&G Artificial Intelligence UCITS ETF | " | ROBO Global® Artificial Intelligence Index |
| L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF | " | ROBO Global® Healthcare Technology and Innovation Index TR |
| L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ⁴ | " | Foxberry Sustainability Consensus Europe TR Index |
| L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ⁵ | " | Foxberry Sustainability Consensus US TR Index |

¹ Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 25. März 2015 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an den Fonds ausgegeben. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, die Zulassung des niemals aufgelegten Fonds zu widerrufen.

² Zwangsweise zurückgenommen am 28. Juni 2019. Die Vermögenswerte des Fonds wurden anschließend veräußert und die Erlöse in bar an diejenigen Personen ausgeschüttet, die am 28. Juni 2019 als Anteilhaber des Fonds registriert waren. Ein Antrag auf Widerruf der Genehmigung der Fonds als OGAW wird bei der Zentralbank gestellt.

³ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 25. Januar 2019 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an den Fonds ausgegeben.

⁴ Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 6. August 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

⁵ Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 6. November 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

| Name des Fonds | Fondsart | Indexname |
|---|-------------------------------------|--|
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | Fonds mit synthetischer Nachbildung | LevDAX® x2 Index |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | " | ShortDAX® x2 Index |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | " | Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | " | FTSE 100® Daily Leveraged Index |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | " | FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | " | Russell 2000® Index |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | " | DAXglobal® Gold Miners Index |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | " | Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR |
| L&G All Commodities UCITS ETF | " | Bloomberg Commodity Index Total Return |
| L&G Foxberry US Large Cap Floored UCITS ETF ⁵ | " | Foxberry Floored Beta US Large Cap @80% TR Index |
| L&G Foxberry EU Large Cap Floored UCITS ETF ⁵ | " | Foxberry Floored Beta EU Large Cap @80% TR Index |
| L&G Foxberry Germany Large Cap Floored UCITS ETF ⁵ | " | Foxberry Floored Beta Germany Large Cap @80% TR Index |
| L&G Foxberry Emerging Markets Floored UCITS ETF ⁵ | " | Foxberry Floored Beta Emerging Markets @80% TR Index |
| L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF | " | Bloomberg ex-Agriculture and Livestock 15/30 Capped 3 Month Forward Total Return Index |
| L&G Multi-Strategy Enhanced Commodities UCITS ETF ⁶ | " | Barclays Backwardation Tilt Multi-Strategy Capped Total Return Index |

⁵ Diese Fonds wurden durch die Zentralbank am 23. Februar 2017 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an den Fonds ausgegeben.

⁶ Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 24. April 2019 zugelassen. Zum Datum dieses Abschlusses waren keine Anteile an dem Fonds ausgegeben.

Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

Anlageziel und Anlagestrategie der Fonds*

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

In Abhängigkeit von der Art des maßgeblichen Index, der vom jeweiligen Fonds nachgebildet/repliziert wird, kann der Anlageverwalter (bzw. der jeweilige Unteranlageverwalter) 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, wird 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.

*Diese Angaben gelten als wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

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 31. Dezember 2019 notiert waren.

| Name des Fonds | Frankfurt Stock Exchange | Euronext Amsterdam | Borsa Italiana | London Stock Exchange | SIX Swiss Exchange | Euronext Paris |
|---|--------------------------|--------------------|----------------|-----------------------|--------------------|----------------|
| L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | ✓ |
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | ✓ | X | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | ✓ | X | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | X | X | X | ✓ | X | X |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | X | X | X | ✓ | X | X |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | ✓ | X | ✓ | ✓ | ✓ | X |
| L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X |

Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

| Name des Fonds | Frankfurt Stock Exchange | Euronext Amsterdam | Borsa Italiana | London Stock Exchange | SIX Swiss Exchange | Euronext Paris |
|---|--------------------------|--------------------|----------------|-----------------------|--------------------|----------------|
| L&G Cyber Security UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X |
| L&G All Commodities UCITS ETF | ✓ | X | X | ✓ | X | X |
| L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF | ✓ | X | X | ✓ | X | X |
| L&G Battery Value-Chain UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G US Equity UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G UK Equity UCITS ETF | X | X | X | ✓ | X | X |
| L&G Japan Equity UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Global Equity UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Clean Water UCITS ETF | ✓ | X | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Artificial Intelligence UCITS ETF | ✓ | X | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF | ✓ | X | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ¹ | X | X | ✓ | ✓ | X | X |
| L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ² | X | X | X | ✓ | X | X |

¹ Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 6. August 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

² Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 6. November 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

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

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

Derzeit werden in den in Betrieb befindlichen Fonds keine abgesicherten Anteilklassen gehalten.

Informationen über die Gesellschaft (Fortsetzung)

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

Die Bezeichnung „NIW“ steht für Nettoinventarwert.

Die Bezeichnung „Verwaltungsgesellschaft“ bezieht sich auf die LGIM ETF Managers Limited.

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

Die Bezeichnung „Anlageverwalter“ bezieht sich auf die GO ETF Solutions LLP.

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 den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019“ bezieht sich auf den sechsmonatigen Berichtszeitraum vom 1. Juli 2019 bis zum 31. Dezember 2019.

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 Berichtszeitraum stellt sich wie folgt dar:

| Fonds | Währung | Auflegungsdatum | TER | NIW zum 31.12.2019 Gesamt | NIW zum 31.12.2019 Je Anteil | Wertentwicklung für den Berichtszeitraum zum 31.12.2019 NIW/Anteil Veränderung in % | Wertentwicklung für den Berichtszeitraum zum 31.12.2019 Indexveränderung in % | Nachbildungsabweichung in % | Erwarteter Tracking Error | Realisierter Tracking Error | Differenz zwischen dem erwarteten Tracking Error und dem realisierten Tracking Error in Basispunkten |
|---|---------|-----------------|--------|---------------------------|------------------------------|---|---|-----------------------------|---------------------------|-----------------------------|--|
| L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF | US\$ | 14.05.2014 | 0,88 % | 26.585.586 | 15,3673 | 6,68 % | 7,17 % | -0,49 % | 2,000 % | 0,509 % | 149,10 |
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | EUR | 18.06.2009 | 0,40 % | 24.145.034 | 321,6464 | 12,40 % | 13,20 % | -0,80 % | 0,080 % | 0,063 % | 1,70 |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | EUR | 18.06.2009 | 0,60 % | 67.872.227 | 3,5444 | -15,99 % | -15,64 % | -0,35 % | 0,090 % | 0,054 % | 3,60 |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | US\$ | 15.03.2010 | 0,30 % | 620.743.737 | 14,2500 | 3,12 % | 3,32 % | -0,20 % | 0,030 % | 0,023 % | 0,70 |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | GBP | 18.06.2009 | 0,50 % | 10.228.813 | 339,5456 | 5,09 % | 6,06 % | -0,97 % | 0,100 % | 0,077 % | 2,30 |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | GBP | 18.06.2009 | 0,60 % | 13.060.034 | 6,5737 | -8,75 % | -8,38 % | -0,37 % | 0,080 % | 0,047 % | 3,30 |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | US\$ | 11.09.2008 | 0,45 % | 62.032.429 | 70,0224 | 7,00 % | 7,07 % | -0,07 % | 0,020 % | 0,017 % | 0,30 |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | US\$ | 11.09.2008 | 0,65 % | 247.932.821 | 29,6840 | 13,87 % | 14,54 % | -0,67 % | 0,050 % | 0,058 % | -0,80 ³ |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF ² | US\$ | 12.05.2014 | 0,25 % | 18.831.364 | 4,6313 | -8,39 % | -7,87 % | -0,52 % | 0,080 % | 0,057 % | 2,30 |
| L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF | US\$ | 23.10.2014 | 0,80 % | 880.526.018 | 16,6638 | 6,25 % | 6,47 % | -0,22 % | 1,000 % | 0,138 % | 86,20 |
| L&G Cyber Security UCITS ETF | US\$ | 22.09.2015 | 0,75 % | 1.066.618.054 | 16,6389 | 4,82 % | 5,34 % | -0,52 % | 1,000 % | 0,323 % | 67,70 |
| L&G All Commodities UCITS ETF ⁴ | US\$ | 05.07.2017 | 0,15 % | 56.248.973 | 10,1234 | 2,39 % | 2,50 % | -0,11 % | 0,030 % | 0,020 % | 1,00 |
| L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF | US\$ | 05.07.2017 | 0,30 % | 9.182.006 | 11,6053 | 4,38 % | 4,59 % | -0,21 % | 0,030 % | 0,027 % | 0,30 |
| L&G Battery Value-Chain UCITS ETF | US\$ | 18.01.2018 | 0,49 % | 51.647.739 | 8,8894 | 9,72 % | 9,67 % | 0,05 % | 0,750 % | 0,308 % | 44,20 |
| L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF | US\$ | 18.01.2018 | 0,49 % | 8.245.506 | 10,3068 | 5,07 % | 5,44 % | -0,37 % | 0,750 % | 0,070 % | 68,00 |
| L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF | US\$ | 18.01.2018 | 0,49 % | 7.658.083 | 10,2107 | 8,16 % | 8,49 % | -0,33 % | 0,750 % | 0,078 % | 67,20 |
| L&G US Equity UCITS ETF | US\$ | 07.11.2018 | 0,05 % | 139.055.352 | 11,8850 | 10,70 % | 10,59 % | 0,11 % | 2,000 % | 0,046 % | 195,40 |
| L&G UK Equity UCITS ETF | GBP | 07.11.2018 | 0,05 % | 9.975.767 | 11,0841 | 3,08 % | 3,31 % | -0,23 % | 0,500 % | 0,133 % | 36,70 |
| L&G Japan Equity UCITS ETF | US\$ | 07.11.2018 | 0,10 % | 115.534.196 | 11,2114 | 11,13 % | 11,13 % | 0,00 % | 2,000 % | 0,168 % | 183,20 |
| L&G Global Equity UCITS ETF | US\$ | 07.11.2018 | 0,10 % | 32.003.973 | 11,8533 | 9,27 % | 9,24 % | 0,03 % | 2,000 % | 0,168 % | 183,20 |
| L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF | EUR | 07.11.2018 | 0,10 % | 102.980.452 | 11,7691 | 8,55 % | 8,46 % | 0,09 % | 2,000 % | 0,061 % | 193,90 |

Fondsbericht (Fortsetzung)

| Fonds | Währung | Auflegungsdatum | TER | NIW zum 31.12.2019 Gesamt | NIW zum 31.12.2019 Je Anteil | Wertentwicklung für den Berichtszeitraum um zum 31.12.2019 NIW/Anteil Veränderung in % | Wertentwicklung für den Berichtszeitraum zum 31.12.2019 Indexveränderung in % | Nachbildungsabweichung in % | Erwarteter Tracking Error | Realisierter Tracking Error | Differenz zwischen dem erwarteten Tracking Error und dem realisierten Tracking Error in Basispunkten |
|---|---------|-----------------|--------|---------------------------|------------------------------|--|---|-----------------------------|---------------------------|-----------------------------|--|
| L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF | US\$ | 07.11.2018 | 0,10 % | 36.168.748 | 11,6673 | 0,91 % | 0,93 % | -0,02 % | 2,000 % | 0,096 % | 190,40 |
| L&G Clean Water UCITS ETF | US\$ | 25.06.2019 | 0,49 % | 2.809.589 | 11,2383 | 11,05 % | 11,32 % | -0,27 % | 0,750 % | 0,056 % | 69,40 |
| L&G Artificial Intelligence UCITS ETF | US\$ | 26.06.2019 | 0,49 % | 3.646.433 | 10,4183 | 5,36 % | 5,67 % | -0,31 % | 0,750 % | 0,125 % | 62,50 |
| L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF | US\$ | 26.06.2019 | 0,49 % | 2.695.179 | 10,7807 | 6,76 % | 7,05 % | -0,29 % | 0,750 % | 0,052 % | 69,80 |
| L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ¹ | EUR | 30.08.2019 | 0,16 % | 227.110.144 | 11,2430 | 1,24 % | Nicht zutreffend | Nicht zutreffend | 2,000 % | Nicht zutreffend | Nicht zutreffend |
| L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ¹ | US\$ | 26.11.2019 | 0,12 % | 570.800.125 | 10,4160 | 0,42 % | Nicht zutreffend | Nicht zutreffend | 2,000 % | Nicht zutreffend | Nicht zutreffend |

¹ Angaben zu NIW, Wertentwicklung und Tracking Error beziehen sich auf den Berichtszeitraum vom angegebenen Auflegungsdatum der einzelnen Fonds bis zum 31. Dezember 2019.

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

³ Der tatsächliche Tracking Error entspricht nicht den Erwartungen.

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 OTC-Swaps 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. Weitere Einzelheiten sind Anmerkung 11 zu entnehmen.

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.

Fondsbericht (Fortsetzung)

Marktkommentar – Dezember 2019

Aktien

Die globalen Aktienindizes konnten im Berichtszeitraum an Boden gewinnen, obwohl sich die Volatilität im August mit der Eskalation der Handelsspannungen zwischen den USA und China wieder etablierte. Die Märkte wurden durch eine expansive Haltung seitens wichtiger Zentralbanken unterstützt, und die US-Notenbank Federal Reserve (die „Fed“) entschied sich für Zinssenkungen im Juli, September und Oktober. Zum Ende des Berichtszeitraums erhielten die Aktien weiteren Auftrieb, da die USA und China ein Abkommen der Phase 1 vereinbarten. Für im Vereinigten Königreich ansässige Anleger führte die Aufwertung des Pfund Sterlings im Vergleich zu anderen wichtigen Währungen zu einer Verwässerung der Gewinne aus den ausländischen Aktienmärkten.

Die Widerstandsfähigkeit der Binnenwirtschaft, insbesondere die Verbrauchernachfrage und die Zinssenkungen der Fed, unterstützten die US-Aktien. Zwar konnte die unterstützende Tendenz der Fed im Zusammenhang mit der Zinspolitik den Rückgang der Industrie in eine allgemeinere Rezession anscheinend effizient stoppen, aber die Anleger haben ihre Erwartungen an das Gewinnwachstum in diesem Jahr dennoch zurückgeschraubt, da die Auswirkungen der Senkung der Körperschaftsteuer nun weitgehend ihren Lauf genommen haben. Die Technologieaktien übertrafen die Wertentwicklung des Marktes und profitierten von vielversprechenden Gewinnankündigungen von mehreren großen Unternehmen. Der Energiesektor war am schwächsten, da das Überangebot, vor allem bei den US-Schieferbeständen, den Ölpreis seit Sommerbeginn unter 70 US\$ pro Barrel gehalten und so die Gewinne der großen Energieunternehmen geschmälert hat.

Britische Aktien schnitten im Berichtszeitraum in Pfund Sterling gegenüber den globalen Indizes leicht besser ab. Zum Jahresende tendierte der Markt kräftig aufwärts, nachdem die Konservativen bei der Parlamentswahl im Dezember einen überzeugenden Sieg einfahren konnten, die politische Pattsituation beendeten und den Weg dafür ebneten, dass das EU-Austrittsabkommen vom Parlament vor Fristablauf im Januar genehmigt wurde. Anteile an kleineren Unternehmen, die eher binnenwirtschaftlich ausgerichtet sind, übertrafen die Wertentwicklung des allgemeineren Marktes aufgrund des Wahlergebnisses deutlich. Mid-Cap-Aktien entwickelten sich ebenfalls gut und wurden durch die anhaltenden Fusions- und Übernahmeaktivitäten befeuert, da die Schwäche des Pfund Sterlings, attraktive Bewertungen und die niedrigen Kreditkosten Übernahmeangebote von an einem Erwerb interessierten Unternehmen und Private-Equity-Anlegern ermutigten.

Europäische Aktienmärkte verbuchten bescheidenere Gewinne, da die Europäische Zentralbank (die „EZB“) die Wiederaufnahme ihres monatlichen Anleihenkaufprogramms beginnend ab November ankündigte, bis die Inflation ihr Ziel von 2 % erreicht. Zum Ende des Berichtszeitraums erholten sich die Finanztitel, da die EZB einen Staffelnzins einführte, um die Auswirkungen der negativen Zinsen auf die Wirtschaftlichkeit der Banken zu mindern. Die geldpolitische Lockerung der EZB war eine Reaktion auf sich abschwächende Konjunkturindikatoren. Der exportabhängige deutsche Fertigungssektor litt weiter unter den globalen Handelsspannungen und dem nachlassenden Wachstum, da die ifo-Umfrage zum Geschäftsklima in der größten Wirtschaft der Eurozone zeigte, dass die Stimmung im August ihren Tiefstwert in sieben Jahren erreicht hatte.

An den asiatisch-pazifischen Märkten sahen wir leicht positive Renditen, und sie blieben etwas hinter den Gewinnen der globalen Aktien zurück. Bedenken im Zusammenhang mit den Prognosen zum Wirtschaftswachstum der Region belasteten die Performance, auch wenn sie zum Ende des Berichtszeitraums wegen des vorläufigen Handelsabkommens zwischen den USA und China etwas nachließen. Wachstumssorgen belasteten zwar einige asiatisch-pazifische Märkte wie Korea und Indonesien, China und Japan entwickelten sich jedoch überdurchschnittlich aufgrund von Optimismus, dass geringere Handelsspannungen zur Steigerung der Exportaussichten beitragen würden. Australische Aktien schnitten jedoch extrem schwach ab, was vor allem an dem Rückschlag Ende 2019 lag, da sich Sorgen um die verheerenden Flächenbrände im Land und deren allgemeine Auswirkungen breit machten.

Die Schwellenmarktaktien lieferten verhaltene Gewinne und blieben im Vergleich zu den globalen Aktien zurück. Die fernöstlichen Märkte, die zunächst aufgrund der Sorgen um die Handelsspannungen und die Auswirkungen der anhaltenden Konjunkturabkühlung in China schwächer abschnitten, lieferten später eine Outperformance, da die Anleger Fortschritte erwarteten, die letztendlich dann zum Handelsabkommen zwischen den USA und China führten. Die osteuropäischen und lateinamerikanischen Märkte wiesen jedoch trotz mehreren Zinssenkungen in Ländern wie Russland, Brasilien und Mexiko eine Underperformance auf. Dies spiegelte teilweise Regierungsprobleme in Polen wider, die Gewinne im energiereichen Russland ausmerzten und Besorgnis, dass Unruhen in Ländern wie Chile weitere Widerstände auf Reformen in anderen Ländern in Lateinamerika auslösen könnten.

Fondsbericht (Fortsetzung)

Marktkommentar – Dezember 2019 (Fortsetzung)

Aktien (Fortsetzung)

Die weltweiten IT-Aktien verbuchten eine starke Performance und stiegen stärker als globale Aktien im Allgemeinen. Zuversicht, dass ein Fortschritt hin zu einem vorläufigen Handelsabkommen zwischen den USA und China (ungeachtet des kurzzeitigen Rücksetzers im August) die globale Nachfrage unterstützen würde, und ermutigende Geschäftszahlen führender IT-Unternehmen verhalfen dem Sektor, beeindruckende Renditen zu erzielen. Die Hardware-Unternehmen profitierten u. a. am stärksten vom Optimismus um weniger Handelsstreitigkeiten und das Vertrauen in das Nachfragewachstum, und die Mikrochip-Hersteller AMD, Nvidia und Micron genossen robuste Aktienkursgewinne. Auch die Apple-Aktien stiegen rasant an, unterstützt durch die steigenden Einkommen aus Dienstleistungen wie dem App Store, besser werdenden Verkaufstrends in China und einer robusten Nachfrage nach AirPods.

Globale Aktien von Gesundheits- und Pharmaunternehmen verzeichneten solide Gewinne und schnitten leicht besser ab als die weltweiten Aktienmärkte. Anhaltende Bedenken um die Auswirkungen der kritischen Blicke der US-Politik auf die Preise im Gesundheitssektor traten anschließend in den Hintergrund, als vielversprechende Nachrichten im Zusammenhang mit der Entwicklung neuer Medikamente dem Sektor Ende 2019 zu einer überdurchschnittlichen Wertentwicklung verhalfen. Das US-Pharmaschwergewicht Bristol-Myers Squibb genoss einen robusten Aktienkursgewinn und verbuchte starke Gewinnrevisionen, die dem Umsatz des blutverdünnenden Medikaments Eliquis zuzuschreiben waren. Auch AbbVie zählte zu den starken Gewinnern, nachdem neu bewertete Versuchsdaten zu Optimismus im Zusammenhang mit einer möglichen Behandlung für Alzheimer führten. Das im Vereinigten Königreich notierte Pharmaunternehmen AstraZeneca erholte sich indessen aufgrund von vielversprechenden Gewinnmeldungen und regulatorischen Genehmigungen.

Anleihen

Die Anleihenmärkte blieben im Berichtszeitraum hinter der Wertentwicklung der globalen Aktienindizes zurück, obwohl die Volatilität am Aktienmarkt im August anstieg. Die Tatsache, dass wichtige Zentralbanken zu einer akkomodierenderen Geldpolitik übergegangen sind, da die Anleger US-Zinserhöhungen im Juli, September und Oktober richtig vorhergesehen hatten, war für risikoreichere Anlageklassen wie Aktien vorteilhafter. Die EZB versicherte den Finanzmärkten, dass sie die Zinsen bis mindestens Mitte des Jahres 2020 nicht anheben werde und gab anschließend die Wiederaufnahme der quantitativen Lockerungsmaßnahmen bekannt. Die Bank of Japan (die „BOJ“) hielt an ihrer negativen Zinspolitik fest und bestätigte erneut, dass sie bei Bedarf intervenieren würde, um die Rendite richtungsweisender 10-jähriger Anleihen bei rund 0 % zu halten.

Gilts übertrafen die Wertentwicklung anderer wichtiger Staatsanleihen, da die Stärke des Pfund Sterling gegenüber anderen wichtigen Währungen die Renditen internationaler festverzinslicher Wertpapiere abschwächte. Indexgebundene Gilts entwickelten sich schlechter als konventionelle Staatsanleihen, da der Inflationsdruck günstig blieb. Auf Sterling lautende Unternehmensanleihen verbuchten moderate Gewinne, angetrieben von der anhaltenden Nachfrage nach Wertpapieren mit höherer Rendite.

Die Anleihenmärkte der Schwellenländer übertrafen die Wertentwicklung wichtiger internationaler Anleihenmärkte im Berichtszeitraum, da niedrigere US-Zinsen die Nachfrage nach Anleihen mit höherer Rendite ansteigen ließen. Dementsprechend war das Emissionsniveau an den Anleihenmärkten der Schwellenländer hoch, da sowohl staatliche Emittenten als auch Unternehmen versuchten, internationale Investoren anzuziehen. Ein Hintergrund mit einem nachlassenden Inflationsdruck und fallendem globalem Wirtschaftswachstum hat in den Wirtschaften der Schwellenländer allgemein zu Zinssenkungen geführt, eine deutliche Umkehr der Tendenz im Vergleich zum Vorjahr.

GO ETF Solutions LLP
20. Januar 2020

Bilanz der Gesellschaft

| | Anm. | Zum 31. Dezember 2019 Insgesamt \$ | Zum 30. Juni 2019 Insgesamt \$ |
|--|------|---|---|
| Vermögenswerte | | | |
| Bankguthaben | 4 | 4.454.949 | 74.754.255 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | 375.980 | 2.910.794 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | |
| - Wertpapiere | 11 | 3.321.545.333 | 2.319.197.879 |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | 113.309.661 | 68.094.114 |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | 25.892.341 | 11.424.591 |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | 1.039.330.822 | 1.007.764.308 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 18.211.504 | 38.535.556 |
| Gesamtvermögenswerte | | 4.523.120.590 | 3.522.681.497 |
| Verbindlichkeiten | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | (507.056) | (938.727) |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | (5.073) | (20.664) |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | (29.027.269) | (13.328.032) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (16.740.676) | (99.225.878) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (46.280.074) | (113.513.301) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 4.476.840.516 | 3.409.168.196 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Gesamtergebnisrechnung der Gesellschaft

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 Insgesamt \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 Insgesamt \$ |
|---|------|---|---|
| Erträge | | | |
| Zinserträge | | 6.095 | 101.644 |
| Dividendenerträge | | 14.787.515 | 9.824.097 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 217.953.339 | (387.421.186) |
| Erträge insgesamt | | 232.746.949 | (377.495.445) |
| Aufwendungen | | | |
| Verwaltungsgebühren | 8 | (10.149.260) | (10.764.832) |
| Sonstige Kosten | | (29.749) | (43.102) |
| Gesamtaufwendungen | | (10.179.009) | (10.807.934) |
| Nettoerträge | | 222.567.940 | (388.303.379) |
| Finanzaufwendungen | | | |
| Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen | 12 | (894.547) | (16.173.105) |
| Zinsaufwand | | (56.183) | (15.716) |
| Finanzaufwendungen insgesamt | | (950.730) | (16.188.821) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern | | 221.617.210 | (404.492.200) |
| Quellensteuer auf Dividenden | | (1.844.126) | (1.660.110) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 219.773.084 | (406.152.310) |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

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

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 Insgesamt \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 Insgesamt \$ |
|--|------|---|---|
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | 3.409.168.196 | 3.707.569.928 |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 219.773.084 | (406.152.310) |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen | 6 | 1.207.348.949 | 476.690.906 |
| Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile | 6 | (361.663.691) | (787.299.537) |
| Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen | | 845.685.258 | (310.608.631) |
| Umrechnungsdifferenzen | | 2.213.978 | (4.338.049) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums | | 4.476.840.516 | 2.986.470.938 |

Kapitalflussrechnung der Gesellschaft

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 Insgesamt \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 Insgesamt \$ |
|---|------|---|---|
| Cashflows aus laufender Geschäftstätigkeit | | | |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 219.773.084 | (406.152.310) |
| Berichtigung aufgrund von: | | | |
| Zinserträgen | | (6.095) | (101.644) |
| Zinsaufwand | | 56.183 | 15.716 |
| Ausschüttung an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile | | 894.547 | 16.173.105 |
| Dividendenerträge | | (14.787.515) | (9.824.097) |
| Quellensteuern | | 1.844.126 | 1.660.110 |
| (Zunahme)/Abnahme des Vermögens: | | | |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | | 2.534.814 | (949.709) |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | (1.081.476.378) | 206.371.582 |
| Forderungen gegenüber Maklern | | 286.201 | (99.042) |
| Sonstige Forderungen | | (238.636) | 371.743 |
| Zunahme/(Abnahme) der Verbindlichkeiten: | | | |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | | 15.699.237 | (1.484.663) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | (27.986.625) | 491.605.154 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Maklern | | (27.535) | (1.417.853) |
| Aufgelaufene Kosten | | (1.180.973) | (322.308) |
| Mittel(abfluss)/-zufluss aus der Geschäftstätigkeit | | (884.615.565) | 295.845.784 |
| Zinsaufwand | | (56.183) | (22.540) |
| Vereinnahmte Zinsen | | 163.280 | 1.429.999 |
| Vereinnahmte Dividenden | | 11.249.159 | 6.675.297 |
| Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus der Geschäftstätigkeit | | (873.259.309) | 303.928.540 |
| Mittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit | | | |
| Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile | | (894.547) | (16.173.105) |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen* | 6 | 1.217.041.593 | 478.357.234 |
| Rücknahmen rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile* | 6 | (415.385.430) | (768.247.224) |
| Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit | | 800.761.616 | (306.063.095) |
| Nettoabnahme von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten | | (72.497.693) | (2.134.555) |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente am Anfang des Berichtszeitraums | | 74.733.591 | 19.893.742 |
| Umrechnungsdifferenzen | | 2.213.978 | (4.338.049) |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums | | 4.449.876 | 13.421.138 |

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

Bilanz

Zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | 31. Dezember 2019 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF € | 31. Dezember 2019 L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF € | 31. Dezember 2019 L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £ | 31. Dezember 2019 L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £ | 31. Dezember 2019 L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$ |
|--|------|---|---|--|---|--|--|--|
| Vermögenswerte | | | | | | | | |
| Bankguthaben | 4 | 239.520 | – | – | 310 | – | 150.000 | 147 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | – | – | – | – | – | 80.000 | 270.000 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Wertpapiere | 11 | 26.365.085 | – | – | – | – | – | – |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | – | 1.702.091 | 4.600.669 | 60.162.161 | 543.381 | 890.727 | 4.163.344 |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | 665.317 | 5.024.747 | – | 118.088 | – |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | – | 22.709.130 | 63.314.000 | 563.767.449 | 9.959.000 | 11.828.751 | 57.709.750 |
| Sonstige Vermögenswerte | | – | – | 3.416 | 198.791 | – | – | 19.973 |
| Gesamtvermögenswerte | | 26.604.605 | 24.411.221 | 68.583.402 | 629.153.458 | 10.502.381 | 13.067.566 | 62.163.214 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | (254.622) | – | – | (96.204) | – | (93.802) |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | – | (105) | (138) | – | – | – | – |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | – | – | (670.000) | (8.050.000) | (170.000) | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (19.019) | (11.460) | (41.037) | (359.721) | (7.364) | (7.532) | (36.983) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (19.019) | (266.187) | (711.175) | (8.409.721) | (273.568) | (7.532) | (130.785) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 26.585.586 | 24.145.034 | 67.872.227 | 620.743.737 | 10.228.813 | 13.060.034 | 62.032.429 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | 31. Dezember 2019 L&G Gold Mining UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF ¹ \$ | 31. Dezember 2019 L&G Cyber Security UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G All Commodities UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$ |
|--|------|---|---|---|--|--|---|--|
| Vermögenswerte | | | | | | | | |
| Bankguthaben | 4 | – | – | 1.614.517 | 1.460.124 | – | – | 87.958 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | – | – | – | – | – | – | – |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Wertpapiere | 11 | – | – | 879.140.968 | 1.063.937.491 | – | – | 51.470.879 |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | 32.762.553 | 2.902.430 | – | – | 3.655.846 | 688.775 | – |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | 17.871.410 | 1.682.131 | – | – | 369.464 | 41.347 | – |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | 215.171.799 | 15.904.700 | – | – | 52.900.070 | 8.454.553 | – |
| Sonstige Vermögenswerte | | 74.468 | 5.505 | 14.456.082 | 1.891.181 | 18.668 | 2.992 | 539.501 |
| Gesamtvermögenswerte | | 265.880.230 | 20.494.766 | 895.211.567 | 1.067.288.796 | 56.944.048 | 9.187.667 | 52.098.338 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – | – |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | (1.002) | (1.703) | – | – | (461) | (173) | – |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | (17.720.000) | (1.610.000) | – | – | (670.000) | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (226.407) | (51.699) | (14.685.549) | (670.742) | (24.614) | (5.488) | (450.599) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (17.947.409) | (1.663.402) | (14.685.549) | (670.742) | (695.075) | (5.661) | (450.599) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 247.932.821 | 18.831.364 | 880.526.018 | 1.066.618.054 | 56.248.973 | 9.182.006 | 51.647.739 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹ Sonstige Vermögenswerte und sonstige Verbindlichkeiten des L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF setzten sich zum 31. Dezember 2019 überwiegend aus Forderungen aus verkauften Wertpapieren und Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen zusammen und beliefen sich auf 13.956.217 US\$ bzw. 13.306.240 US\$.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | 31. Dezember 2019 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G US Equity UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G UK Equity UCITS ETF £ | 31. Dezember 2019 L&G Japan Equity UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G Global Equity UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF € |
|--|------|--|--|---|--|--|---|--|
| Vermögenswerte | | | | | | | | |
| Bankguthaben | 4 | 14.692 | 12.079 | 100.610 | 7.378 | 31.809 | 112.738 | 108.370 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | – | – | – | – | – | – | – |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Wertpapiere | 11 | 8.234.283 | 7.646.854 | 138.835.416 | 9.942.881 | 115.361.098 | 31.863.399 | 102.876.109 |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – | – |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – | – |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | – | – | – | – | – | – | – |
| Sonstige Vermögenswerte | | – | 2.234 | 125.031 | 25.925 | 151.124 | 30.459 | 4.657 |
| Gesamtvermögenswerte | | 8.248.975 | 7.661.167 | 139.061.057 | 9.976.184 | 115.544.031 | 32.006.596 | 102.989.136 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – | – |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | – | – | – | – | – | – | – |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | – | – | – | – | – | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (3.469) | (3.084) | (5.705) | (417) | (9.835) | (2.623) | (8.684) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (3.469) | (3.084) | (5.705) | (417) | (9.835) | (2.623) | (8.684) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 8.245.506 | 7.658.083 | 139.055.352 | 9.975.767 | 115.534.196 | 32.003.973 | 102.980.452 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | 31. Dezember 2019 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G Clean Water UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$ | 31. Dezember 2019 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ¹ € | 31. Dezember 2019 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ² \$ |
|--|------|---|---|--|--|--|---|
| Vermögenswerte | | | | | | | |
| Bankguthaben | 4 | 74.488 | 5.586 | 4.584 | – | 40.926 | 319.719 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | – | – | – | – | – | – |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | |
| - Wertpapiere | 11 | 36.054.751 | 2.801.585 | 3.642.744 | 2.697.523 | 226.952.836 | 570.095.282 |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | – | – | – | – | – | – |
| Sonstige Vermögenswerte | | 42.461 | 3.563 | 476 | 232 | 146.884 | 440.484 |
| Gesamtvermögenswerte | | 36.171.700 | 2.810.734 | 3.647.804 | 2.697.755 | 227.140.646 | 570.855.485 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | – | – | – | (1.461) | – | – |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | – | – | – | – | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (2.952) | (1.145) | (1.371) | (1.115) | (30.502) | (55.360) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (2.952) | (1.145) | (1.371) | (2.576) | (30.502) | (55.360) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 36.168.748 | 2.809.589 | 3.646.433 | 2.695.179 | 227.110.144 | 570.800.125 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

²Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

Bilanz

Zum 30. Juni 2019

| | Anm. | 30. Juni 2019 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF € | 30. Juni 2019 L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF € | 30. Juni 2019 L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £ | 30. Juni 2019 L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £ | 30. Juni 2019 L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$ |
|--|------|---|---|--|---|--|--|--|
| Vermögenswerte | | | | | | | | |
| Bankguthaben | 4 | 304.584 | 5.415.140 | 3.844.246 | 895 | – | – | 18.053 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | – | 500.000 | – | – | – | 87.000 | 1.339.941 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Wertpapiere | 11 | 23.928.786 | – | – | – | – | – | – |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | – | – | – | 43.868.974 | 431.248 | 975.133 | 2.126.977 |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | 228.795 | – | 3.674.727 | 10.627 | – | 121.008 |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | – | 30.435.515 | 65.550.481 | 550.666.365 | 5.686.924 | 13.281.737 | 45.557.021 |
| Sonstige Vermögenswerte | | – | – | 1.195 | 4.115.588 | – | 1.015 | 12.016 |
| Gesamtvermögenswerte | | 24.233.370 | 36.579.450 | 69.395.922 | 602.326.549 | 6.128.799 | 14.344.885 | 49.175.016 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | (537.327) | – | – | (25.402) | – |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | – | – | – | – | (142) | (330) | – |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | – | – | (920.000) | (6.513.495) | – | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (32.639) | (3.158.259) | (73.011) | (6.386.723) | (5.646) | (14.318) | (42.994) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (32.639) | (3.158.259) | (1.530.338) | (12.900.218) | (5.788) | (40.050) | (42.994) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 24.200.731 | 33.421.191 | 67.865.584 | 589.426.331 | 6.123.011 | 14.304.835 | 49.132.022 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2019

| | Anm. | 30. Juni 2019 L&G Gold Mining UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF ² \$ | 30. Juni 2019 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ € | 30. Juni 2019 L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ \$ | 30. Juni 2019 L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ \$ | 30. Juni 2019 L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ \$ |
|--|------|---|--|--|--|---|--|--|
| Vermögenswerte | | | | | | | | |
| Bankguthaben | 4 | 1.197 | 6.209 | 713.854 | 5.413.725 | 24.003.335 | 5.224.208 | 24.625.038 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | – | 890.738 | – | – | – | – | – |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Wertpapiere | 11 | – | – | 931.605.800 | – | – | – | – |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | 13.401.929 | 1.549.273 | – | – | – | – | – |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | 6.839.621 | – | – | – | – | – | – |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | 195.643.135 | 25.843.485 | – | – | – | – | – |
| Sonstige Vermögenswerte | | 156.365 | 27.431.566 | 1.165.216 | – | – | – | – |
| Gesamtvermögenswerte | | 216.042.247 | 55.721.271 | 933.484.870 | 5.413.725 | 24.003.335 | 5.224.208 | 24.625.038 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | (294.501) | – | – | – | – | – |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | – | – | – | – | – | – | – |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | (4.919.398) | – | – | – | – | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (261.159) | (25.976.008) | (1.201.558) | (5.413.725) | (24.003.335) | (5.224.208) | (24.625.038) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (5.180.557) | (26.270.509) | (1.201.558) | (5.413.725) | (24.003.335) | (5.224.208) | (24.625.038) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 210.861.690 | 29.450.762 | 932.283.312 | – | – | – | – |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹ Zwangsweise zurückgenommen am 28. Juni 2019. Die Vermögenswerte des Fonds wurden anschließend veräußert und die Erlöse in bar an diejenigen Personen ausgeschüttet, die am 28. Juni 2019 als Anteilhaber des Fonds registriert waren. Der an Anteilhaber zum 30. Juni 2019 zahlbare Rücknahmebetrag ist als „Sonstige Verbindlichkeiten“ in der Bilanz ausgewiesen. Nach der Veröffentlichung des geprüften Jahresberichts und Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 wurde bei der Zentralbank ein Antrag auf Widerruf der Genehmigung dieses Fonds als OGAW gestellt.

² Sonstige Vermögenswerte und sonstige Verbindlichkeiten des L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF setzten sich zum 30. Juni 2019 überwiegend aus Forderungen aus verkauften Wertpapieren und Verbindlichkeiten aus gekauften Wertpapieren zusammen und beliefen sich auf 26.235.485 US\$ bzw. 24.830.485 US\$.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2019

| | Anm. | 30. Juni 2019 L&G Cyber Security UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G All Commodities UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G US Equity UCITS ETF \$ |
|--|------|--|--|---|--|--|--|---|
| Vermögenswerte | | | | | | | | |
| Bankguthaben | 4 | 2.002.675 | 21 | 201.931 | 103.759 | 15.212 | 8.032 | 248.070 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | – | – | – | – | – | – | – |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Wertpapiere | 11 | 911.625.932 | – | – | 46.988.976 | 7.841.435 | 4.712.300 | 112.408.028 |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | – | 4.624.037 | 733.023 | – | – | – | – |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | 342.712 | 172.451 | – | – | – | – |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | – | 48.713.000 | 7.893.000 | – | – | – | – |
| Sonstige Vermögenswerte | | 5.159.213 | 19.426 | 2.143 | 33.929 | 4 | 4.653 | 80.731 |
| Gesamtvermögenswerte | | 918.787.820 | 53.699.196 | 9.002.548 | 47.126.664 | 7.856.651 | 4.724.985 | 112.736.829 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – | – |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | – | – | – | – | – | – | – |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | – | (647.793) | (199.669) | – | – | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (1.180.164) | (24.434) | (6.180) | (52.333) | (9.028) | (4.714) | (8.832) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (1.180.164) | (672.227) | (205.849) | (52.333) | (9.028) | (4.714) | (8.832) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 917.607.656 | 53.026.969 | 8.796.699 | 47.074.331 | 7.847.623 | 4.720.271 | 112.727.997 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2019

| | Anm. | 30. Juni 2019 L&G UK Equity UCITS ETF £ | 30. Juni 2019 L&G Japan Equity UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G Global Equity UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF € | 30. Juni 2019 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G Clean Water UCITS ETF \$ | 30. Juni 2019 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$ |
|--|------|--|--|---|--|---|---|--|
| Vermögenswerte | | | | | | | | |
| Bankguthaben | 4 | 23.642 | 288.727 | 56.120 | 156.390 | – | 4.978 | 4.810 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | – | – | – | – | – | – | – |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Wertpapiere | 11 | 9.606.775 | 93.180.252 | 28.130.997 | 100.128.524 | 26.517.762 | 2.019.176 | 1.972.857 |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – | – |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – | – |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | – | – | – | – | – | – | – |
| Sonstige Vermögenswerte | | 48.477 | 122.135 | 32.427 | 32.138 | 99.069 | 51 | – |
| Gesamtvermögenswerte | | 9.678.894 | 93.591.114 | 28.219.544 | 100.317.052 | 26.616.831 | 2.024.205 | 1.977.667 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | | | | | | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – | – | – | – | – | – | – |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | – | – | – | – | (20.063) | – | – |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | – | – | – | – | – | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (767) | (269.035) | (15.690) | (23.092) | (4.118) | (107) | (78) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (767) | (269.035) | (15.690) | (23.092) | (24.181) | (107) | (78) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 9.678.127 | 93.322.079 | 28.203.854 | 100.293.960 | 26.592.650 | 2.024.098 | 1.977.589 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2019

| | Anm. | 30. Juni 2019 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$ |
|--|------|--|
| Vermögenswerte | | |
| Bankguthaben | 4 | 4.926 |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten | 5 | – |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | |
| - Wertpapiere | 11 | 2.014.722 |
| - Geldmarktinstrumente | 11 | – |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – |
| - Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 5,11 | – |
| Sonstige Vermögenswerte | | 77 |
| Gesamtvermögenswerte | | 2.019.725 |
| Verbindlichkeiten | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | | |
| - Derivative Finanzinstrumente | 11 | – |
| Kontokorrentverbindlichkeiten | 4 | – |
| Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten | 5 | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | (79) |
| Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen) | | (79) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 2.019.646 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Gesamtergebnisrechnung

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 |
|---|------|---|--|--|--|---|---|---|
| | | 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 \$ |
| Erträge | | | | | | | | |
| Zinserträge | | 783 | – | – | – | 2 | – | 1.042 |
| Dividendenerträge | | 239.695 | – | – | – | – | – | – |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 1.630.184 | 3.521.631 | (14.269.697) | 18.832.836 | 1.048.318 | (649.647) | 4.245.263 |
| Erträge insgesamt | | 1.870.662 | 3.521.631 | (14.269.697) | 18.832.836 | 1.048.320 | (649.647) | 4.246.305 |
| Aufwendungen | | | | | | | | |
| Verwaltungsgebühren | 8 | (110.380) | (57.349) | (227.411) | (864.284) | (19.425) | (44.338) | (126.947) |
| Sonstige Kosten | | – | (1.945) | (2.301) | (3.295) | (943) | (1.213) | (1.711) |
| Gesamtaufwendungen | | (110.380) | (59.294) | (229.712) | (867.579) | (20.368) | (45.551) | (128.658) |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | 1.760.282 | 3.462.337 | (14.499.409) | 17.965.257 | 1.027.952 | (695.198) | 4.117.647 |
| Finanzaufwendungen | | | | | | | | |
| Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen | 12 | – | – | – | – | – | – | – |
| Zinsaufwand | | – | (5.653) | (12.682) | (1.172) | – | (10) | – |
| Finanzaufwendungen insgesamt | | – | (5.653) | (12.682) | (1.172) | – | (10) | – |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern | | 1.760.282 | 3.456.684 | (14.512.091) | 17.964.085 | 1.027.952 | (695.208) | 4.117.647 |
| Quellensteuer auf Dividenden | | (24.152) | – | – | – | – | – | – |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 1.736.130 | 3.456.684 | (14.512.091) | 17.964.085 | 1.027.952 | (695.208) | 4.117.647 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Gold Mining UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Cyber Security UCITS ETF € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G All Commodities UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$ |
|---|------|--|--|---|--|---|--|---|
| Erträge | | | | | | | | |
| Zinserträge | | 3.203 | 359 | – | – | – | – | – |
| Dividendenerträge | | – | – | 4.342.865 | 3.864.011 | – | – | 380.722 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 29.913.869 | (2.150.962) | 49.192.532 | 48.852.233 | 1.343.823 | 399.817 | 3.812.356 |
| Erträge insgesamt | | 29.917.072 | (2.150.603) | 53.535.397 | 52.716.244 | 1.343.823 | 399.817 | 4.193.078 |
| Aufwendungen | | | | | | | | |
| Verwaltungsgebühren | 8 | (795.617) | (30.715) | (3.529.770) | (3.688.854) | (41.772) | (13.607) | (138.295) |
| Sonstige Kosten | | (3.179) | (1.318) | (1.787) | (2.070) | (1.579) | (594) | (281) |
| Gesamtaufwendungen | | (798.796) | (32.033) | (3.531.557) | (3.690.924) | (43.351) | (14.201) | (138.576) |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | 29.118.276 | (2.182.636) | 50.003.840 | 49.025.320 | 1.300.472 | 385.616 | 4.054.502 |
| Finanzaufwendungen | | | | | | | | |
| Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen | 12 | – | (894.547) | – | – | – | – | – |
| Zinsaufwand | | – | – | (9.859) | (22.872) | (996) | (309) | (109) |
| Finanzaufwendungen insgesamt | | – | (894.547) | (9.859) | (22.872) | (996) | (309) | (109) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern | | 29.118.276 | (3.077.183) | 49.993.981 | 49.002.448 | 1.299.476 | 385.307 | 4.054.393 |
| Quellensteuer auf Dividenden | | (38.895) | – | (662.685) | (447.814) | – | – | (67.765) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 29.079.381 | (3.077.183) | 49.331.296 | 48.554.634 | 1.299.476 | 385.307 | 3.986.628 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G US Equity UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G UK Equity UCITS ETF £ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Japan Equity UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Global Equity UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF € |
|---|------|---|---|--|---|---|--|---|
| Erträge | | | | | | | | |
| Zinserträge | | 56 | 20 | 191 | 11 | 90 | 187 | – |
| Dividenderträge | | 13.174 | 41.203 | 1.203.231 | 202.234 | 1.257.354 | 303.614 | 452.523 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 411.362 | 500.177 | 11.839.584 | 100.154 | 10.246.781 | 2.371.769 | 7.673.534 |
| Erträge insgesamt | | 424.592 | 541.400 | 13.043.006 | 302.399 | 11.504.225 | 2.675.570 | 8.126.057 |
| Aufwendungen | | | | | | | | |
| Verwaltungsgebühren | 8 | (24.277) | (16.867) | (31.126) | (2.464) | (53.804) | (14.728) | (50.574) |
| Sonstige Kosten | | (694) | (190) | (597) | (247) | (395) | (855) | (1.069) |
| Gesamtaufwendungen | | (24.971) | (17.057) | (31.723) | (2.711) | (54.199) | (15.583) | (51.643) |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | 399.621 | 524.343 | 13.011.283 | 299.688 | 11.450.026 | 2.659.987 | 8.074.414 |
| Finanzaufwendungen | | | | | | | | |
| Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen | 12 | – | – | – | – | – | – | – |
| Zinsaufwand | | – | – | – | – | – | – | (385) |
| Finanzaufwendungen insgesamt | | – | – | – | – | – | – | (385) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern | | 399.621 | 524.343 | 13.011.283 | 299.688 | 11.450.026 | 2.659.987 | 8.074.029 |
| Quellensteuer auf Dividenden | | (1.738) | (7.836) | (169.748) | (2.048) | (188.603) | (34.438) | 14.673 |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 397.883 | 516.507 | 12.841.535 | 297.640 | 11.261.423 | 2.625.549 | 8.088.702 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Clean Water UCITS ETF ¹ \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF ² \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF ² \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ³ € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ⁴ \$ |
|---|------|--|---|--|--|---|--|
| Erträge | | | | | | | |
| Zinserträge | | 82 | 14 | – | 52 | – | – |
| Dividendenerträge | | 524.501 | 14.855 | 3.553 | 2.223 | 806.469 | 947.862 |
| Nettogewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | 108.439 | 246.828 | 173.530 | 175.936 | 18.445.363 | 18.195.536 |
| Erträge insgesamt | | 633.022 | 261.697 | 177.083 | 178.211 | 19.251.832 | 19.143.398 |
| Aufwendungen | | | | | | | |
| Verwaltungsgebühren | 8 | (15.276) | (5.606) | (5.507) | (6.135) | (108.876) | (59.748) |
| Sonstige Kosten | | (1.015) | (397) | (309) | (310) | (224) | – |
| Gesamtaufwendungen | | (16.291) | (6.003) | (5.816) | (6.445) | (109.100) | (59.748) |
| Nettoerträge | | 616.731 | 255.694 | 171.267 | 171.766 | 19.142.732 | 19.083.650 |
| Finanzaufwendungen | | | | | | | |
| Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen | 12 | – | – | – | – | – | – |
| Zinsaufwand | | – | – | (1) | – | (71) | – |
| Finanzaufwendungen insgesamt | | – | – | (1) | – | (71) | – |
| Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern | | 616.731 | 255.694 | 171.266 | 171.766 | 19.142.661 | 19.083.650 |
| Quellensteuer auf Dividenden | | (8.563) | (1.543) | (547) | (253) | (63.937) | (132.555) |
| Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 608.168 | 254.151 | 170.719 | 171.513 | 19.078.724 | 18.951.095 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹Der Fonds wurde am 25. Juni 2019 aufgelegt.

²Der Fonds wurde am 26. Juni 2019 aufgelegt.

³Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

⁴Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

Gesamtergebnisrechnung

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$ |
|---|------|---|---|--|--|---|---|---|
| Erträge | | | | | | | | |
| Zinserträge | | 633 | – | – | 234 | 23.401 | 51.034 | – |
| Dividendenerträge | | 203.054 | – | – | – | – | – | – |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | (3.701.312) | (9.689.198) | 19.904.630 | (79.158.129) | (1.880.831) | 3.032.799 | (9.536.704) |
| Erträge insgesamt | | (3.497.625) | (9.689.198) | 19.904.630 | (79.157.895) | (1.857.430) | 3.083.833 | (9.536.704) |
| Aufwendungen | | | | | | | | |
| Verwaltungsgebühren | 8 | (84.979) | (62.619) | (222.164) | (1.133.242) | (18.548) | (49.391) | (124.027) |
| Sonstige Kosten | | (4.700) | (1.500) | (2.040) | (3.995) | (1.049) | (1.359) | (1.310) |
| Gesamtaufwendungen | | (89.679) | (64.119) | (224.204) | (1.137.237) | (19.597) | (50.750) | (125.337) |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | (3.587.304) | (9.753.317) | 19.680.426 | (80.295.132) | (1.877.027) | 3.033.083 | (9.662.041) |
| Finanzaufwendungen | | | | | | | | |
| Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen | 12 | – | – | – | – | – | – | – |
| Zinsaufwand | | – | (739) | (845) | – | – | – | (1.143) |
| Finanzaufwendungen insgesamt | | – | (739) | (845) | – | – | – | (1.143) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern | | (3.587.304) | (9.754.056) | 19.679.581 | (80.295.132) | (1.877.027) | 3.033.083 | (9.663.184) |
| Quellensteuer auf Dividenden | | (20.391) | – | – | – | – | – | – |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | (3.607.695) | (9.754.056) | 19.679.581 | (80.295.132) | (1.877.027) | 3.033.083 | (9.663.184) |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Gold Mining UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ \$ |
|---|------|--|--|---|---|--|---|---|
| Erträge | | | | | | | | |
| Zinserträge | | 488 | – | – | – | – | 3.691 | – |
| Dividendenerträge | | – | – | 6.472.001 | – | – | – | – |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | (5.066.452) | (2.681.703) | (215.014.344) | (79.826) | (3.344.239) | (1.001.473) | (5.057.533) |
| Erträge insgesamt | | (5.065.964) | (2.681.703) | (208.542.343) | (79.826) | (3.344.239) | (997.782) | (5.057.533) |
| Aufwendungen | | | | | | | | |
| Verwaltungsgebühren | 8 | (566.395) | (39.276) | (4.688.656) | (21.814) | (172.824) | (48.046) | (562.651) |
| Sonstige Kosten | | (2.597) | (1.838) | (977) | (561) | (1.133) | (5.148) | (10.955) |
| Gesamtaufwendungen | | (568.992) | (41.114) | (4.689.633) | (22.375) | (173.957) | (53.194) | (573.606) |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | (5.634.956) | (2.722.817) | (213.231.976) | (102.201) | (3.518.196) | (1.050.976) | (5.631.139) |
| Finanzaufwendungen | | | | | | | | |
| Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen | 12 | – | (1.120.270) | – | (136.814) | (1.464.248) | (153.405) | (13.277.586) |
| Zinsaufwand | | – | (452) | (1.045) | (1.632) | (529) | – | (7.667) |
| Finanzaufwendungen insgesamt | | – | (1.120.722) | (1.045) | (138.446) | (1.464.777) | (153.405) | (13.285.253) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern | | (5.634.956) | (3.843.539) | (213.233.021) | (240.647) | (4.982.973) | (1.204.381) | (18.916.392) |
| Quellensteuer auf Dividenden | | (28.050) | – | (991.118) | (728) | (1.075) | (1.403) | (200.123) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | (5.663.006) | (3.843.539) | (214.224.139) | (241.375) | (4.984.048) | (1.205.784) | (19.116.515) |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹ Zwangsweise zurückgenommen am 28. Juni 2019. Die Vermögenswerte des Fonds wurden anschließend veräußert und die Erlöse in bar an diejenigen Personen ausgeschüttet, die am 28. Juni 2019 als Anteilinhaber des Fonds registriert waren. Nach der Veröffentlichung des geprüften Jahresberichts und Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 wurde bei der Zentralbank ein Antrag auf Widerruf der Genehmigung dieses Fonds als OGAW gestellt.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Cyber Security UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G All Commodities UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G US Equity UCITS ETF ¹ \$ |
|---|------|---|---|--|---|---|---|---|
| Erträge | | | | | | | | |
| Zinserträge | | – | 34 | 132 | – | – | 13 | 28 |
| Dividendenerträge | | 2.610.090 | – | – | 230.609 | 8.024 | 20.791 | 60.294 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | (56.410.602) | (4.568.586) | (2.827.122) | (4.056.129) | (846.180) | (773.066) | (1.822.028) |
| Erträge insgesamt | | (53.800.512) | (4.568.552) | (2.826.990) | (3.825.520) | (838.156) | (752.262) | (1.761.706) |
| Aufwendungen | | | | | | | | |
| Verwaltungsgebühren | 8 | (2.700.639) | (33.053) | (21.527) | (101.970) | 22.818 | 13.061 | (1.261) |
| Sonstige Kosten | | – | (1.471) | (1.136) | – | – | – | – |
| Gesamtaufwendungen | | (2.700.639) | (34.524) | (22.663) | (101.970) | (22.818) | (13.061) | (1.261) |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | (56.501.151) | (4.603.076) | (2.849.653) | (3.927.490) | (860.974) | (765.323) | (1.762.967) |
| Finanzaufwendungen | | | | | | | | |
| Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen | 12 | – | – | – | – | – | – | – |
| Zinsaufwand | | (520) | – | – | (142) | (9) | – | – |
| Finanzaufwendungen insgesamt | | (520) | – | – | (142) | (9) | – | – |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern | | (56.501.671) | (4.603.076) | (2.849.653) | (3.927.632) | (860.983) | (765.323) | (1.762.967) |
| Quellensteuer auf Dividenden | | (340.913) | – | – | (39.877) | (1.117) | (2.455) | (9.331) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | (56.842.584) | (4.603.076) | (2.849.653) | (3.967.509) | (862.100) | (767.778) | (1.772.298) |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹ Die Fonds wurden am 7. November 2018 aufgelegt.

Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G UK Equity UCITS ETF ¹ £ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Japan Equity UCITS ETF ¹ \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Global Equity UCITS ETF ¹ \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF ¹ € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF ¹ \$ |
|---|------|--|--|---|--|---|
| Erträge | | | | | | |
| Zinserträge | | – | – | 6 | – | 20 |
| Dividenderträge | | 30.073 | 27.646 | 54.313 | 26.210 | 68.150 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 2 | (290.503) | (1.086.506) | (1.454.378) | (1.239.051) | (377.936) |
| Erträge insgesamt | | (260.430) | (1.058.860) | (1.400.059) | (1.212.841) | (309.766) |
| Aufwendungen | | | | | | |
| Verwaltungsgebühren | 8 | (360) | (2.519) | (2.137) | (2.343) | (1.461) |
| Sonstige Kosten | | – | – | – | – | – |
| Gesamtaufwendungen | | (360) | (2.519) | (2.137) | (2.343) | (1.461) |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | (260.790) | (1.061.379) | (1.402.196) | (1.215.184) | (311.227) |
| Finanzaufwendungen | | | | | | |
| Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen | 12 | – | – | – | – | – |
| Zinsaufwand | | (3) | (492) | – | (7) | – |
| Finanzaufwendungen insgesamt | | (3) | (492) | – | (7) | – |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern | | (260.793) | (1.061.871) | (1.402.196) | (1.215.191) | (311.227) |
| Quellensteuer auf Dividenden | | (538) | (4.147) | (9.249) | (6.339) | (2.024) |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | (261.331) | (1.066.018) | (1.411.445) | (1.221.530) | (313.251) |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹ Die Fonds wurden am 7. November 2018 aufgelegt.

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

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$ |
|--|------|--|--|---|---|--|---|--|
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | 24.200.731 | 33.421.191 | 67.865.584 | 589.426.331 | 6.123.011 | 14.304.835 | 49.132.022 |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 1.736.130 | 3.456.684 | (14.512.091) | 17.964.085 | 1.027.952 | (695.208) | 4.117.647 |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen | 6 | 2.095.470 | 31.060.710 | 31.305.872 | 66.820.479 | 13.017.935 | 8.268.356 | 11.887.120 |
| Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile | 6 | (1.446.745) | (43.793.551) | (16.787.138) | (53.467.158) | (9.940.085) | (8.817.949) | (3.104.360) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen | | 648.725 | (12.732.841) | 14.518.734 | 13.353.321 | 3.077.850 | (549.593) | 8.782.760 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums | | 26.585.586 | 24.145.034 | 67.872.227 | 620.743.737 | 10.228.813 | 13.060.034 | 62.032.429 |

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Gold Mining UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Cyber Security UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G All Commodities UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Battery Value-Chain UCITS ETF \$ |
|--|------|--|---|---|---|--|--|--|
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | 210.861.690 | 29.450.762 | 932.283.312 | 917.607.656 | 53.026.969 | 8.796.699 | 47.074.331 |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 29.079.381 | (3.077.183) | 49.331.296 | 48.554.634 | 1.299.476 | 385.307 | 3.986.628 |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen | 6 | 42.094.188 | 5.225.960 | 16.505.040 | 126.817.824 | 4.332.226 | – | 9.959.410 |
| Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile | 6 | (34.102.438) | (12.768.175) | (117.593.630) | (26.362.060) | (2.409.698) | – | (9.372.630) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen | | 7.991.750 | (7.542.215) | (101.088.590) | 100.455.764 | 1.922.528 | – | 586.780 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums | | 247.932.821 | 18.831.364 | 880.526.018 | 1.066.618.054 | 56.248.973 | 9.182.006 | 51.647.739 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

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

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G US Equity UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G UK Equity UCITS ETF £ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Japan Equity UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Global Equity UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF € |
|--|------|---|---|---|--|--|---|--|
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | 7.847.623 | 4.720.271 | 112.727.997 | 9.678.127 | 93.322.079 | 28.203.854 | 100.293.960 |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 397.883 | 516.507 | 12.841.535 | 297.640 | 11.261.423 | 2.625.549 | 8.088.702 |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen | 6 | – | 2.421.305 | 13.485.820 | – | 15.133.784 | 1.174.570 | – |
| Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile | 6 | – | – | – | – | (4.183.090) | – | (5.402.210) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen | | – | 2.421.305 | 13.485.820 | – | 10.950.694 | 1.174.570 | (5.402.210) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums | | 8.245.506 | 7.658.083 | 139.055.352 | 9.975.767 | 115.534.196 | 32.003.973 | 102.980.452 |

| | Anm. | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Clean Water UCITS ETF ¹ \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF ² \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF ² \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ³ € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ⁴ \$ |
|--|------|--|--|--|--|--|---|
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | 26.592.650 | 2.024.098 | 1.977.589 | 2.019.646 | – | – |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | 608.168 | 254.151 | 170.719 | 171.513 | 19.078.724 | 18.951.095 |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen | 6 | 8.967.930 | 531.340 | 1.498.125 | 504.020 | 208.031.420 | 551.849.030 |
| Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile | 6 | – | – | – | – | – | – |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen | | 8.967.930 | 531.340 | 1.498.125 | 504.020 | 208.031.420 | 551.849.030 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums | | 36.168.748 | 2.809.589 | 3.646.433 | 2.695.179 | 227.110.144 | 570.800.125 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹Der Fonds wurde am 25. Juni 2019 aufgelegt.

²Die Fonds wurden am 26. Juni 2019 aufgelegt.

³Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

⁴Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

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

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018

| | Anm. | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF € | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF € | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$ |
|--|------|---|---|--|--|---|---|---|
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | 20.352.408 | 33.130.560 | 78.174.952 | 882.075.669 | 7.068.884 | 18.633.818 | 54.250.917 |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | (3.607.695) | (9.754.056) | 19.679.581 | (80.295.132) | (1.877.027) | 3.033.083 | (9.663.184) |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen | 6 | 1.282.760 | 19.186.188 | 12.620.650 | 94.366.517 | 6.999.738 | 4.840.650 | 6.423.764 |
| Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile | 6 | – | (9.377.952) | (38.247.211) | (367.210.324) | (5.179.054) | (13.310.677) | (10.496.741) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen | | 1.282.760 | 9.808.236 | (25.626.561) | (272.843.807) | 1.820.684 | (8.470.027) | (4.072.977) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums | | 18.027.473 | 33.184.740 | 72.227.972 | 528.936.730 | 7.012.541 | 13.196.874 | 40.514.756 |

| | Anm. | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G Gold Mining UCITS ETF \$ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ € | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ \$ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L & G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ \$ |
|--|------|--|--|---|---|--|---|
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | 191.506.566 | 30.119.528 | 1.202.590.627 | 14.700.397 | 112.684.582 | 40.346.635 |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | (5.663.006) | (3.843.539) | (214.224.139) | (241.375) | (4.984.048) | (1.205.784) |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen | 6 | 14.791.293 | 5.050.884 | 9.459.580 | – | 16.355.845 | 1.613.007 |
| Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile | 6 | (14.554.900) | (5.321.973) | (69.211.840) | (252.902) | (20.649.507) | (17.944.463) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen | | 236.393 | (271.089) | (59.752.260) | (252.902) | (4.293.662) | (16.331.456) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums | | 186.079.953 | 26.004.900 | 928.614.228 | 14.206.120 | 103.406.872 | 22.809.395 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹ Zwangsweise zurückgenommen am 28. Juni 2019. Die Vermögenswerte des Fonds wurden anschließend veräußert und die Erlöse in bar an diejenigen Personen ausgeschüttet, die am 28. Juni 2019 als Anteilhaber des Fonds registriert waren. Nach der Veröffentlichung des geprüften Jahresberichts und Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 wurde bei der Zentralbank ein Antrag auf Widerruf der Genehmigung dieses Fonds als OGAW gestellt.

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

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018

| | Anm. | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ \$ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Cyber Security UCITS ETF \$ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G All Commodities UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$ |
|--|------|---|---|---|--|---|---|---|
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | 256.845.384 | 642.041.827 | 21.786.295 | 38.235.287 | 27.792.947 | 2.972.122 | 2.912.169 |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | (19.116.515) | (56.842.584) | (4.603.076) | (2.849.653) | (3.967.509) | (862.100) | (767.778) |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen | 6 | 934.510 | 126.223.348 | 31.408.765 | 294.278 | 9.152.240 | 4.750.910 | 968.390 |
| Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile | 6 | (81.402.605) | (85.371.445) | (5.144.625) | (27.447.365) | (3.455.640) | – | – |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen | | (80.468.095) | 40.851.903 | 26.264.140 | (27.153.087) | 5.696.600 | 4.750.910 | 968.390 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums | | 157.260.774 | 626.051.146 | 43.447.359 | 8.232.547 | 29.522.038 | 6.860.932 | 3.112.781 |

| | Anm. | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G US Equity UCITS ETF ² \$ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G UK Equity UCITS ETF ² £ | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Japan Equity UCITS ETF ² \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Global Equity UCITS ETF ² \$ | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF ² € | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF ² \$ |
|--|------|---|--|--|---|--|---|
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | – | – | – | – | – | – |
| Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern | | (1.772.298) | (261.331) | (1.066.018) | (1.411.445) | (1.221.530) | (313.251) |
| Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen | 6 | 33.418.420 | 4.998.100 | 17.422.650 | 15.281.850 | 16.476.405 | 10.074.800 |
| Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile | 6 | – | – | – | – | – | – |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Vermögens aus Geschäften mit Anteilen | | 33.418.420 | 4.998.100 | 17.422.650 | 15.281.850 | 16.476.405 | 10.074.800 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums | | 31.646.122 | 4.736.769 | 16.356.632 | 13.870.405 | 15.254.875 | 9.761.549 |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresabschlusses.

¹ Zwangsweise zurückgenommen am 28. Juni 2019. Die Vermögenswerte des Fonds wurden anschließend veräußert und die Erlöse in bar an diejenigen Personen ausgeschüttet, die am 28. Juni 2019 als Anteilinhaber des Fonds registriert waren. Nach der Veröffentlichung des geprüften Jahresberichts und Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 wurde bei der Zentralbank ein Antrag auf Widerruf der Genehmigung dieses Fonds als OGAW gestellt.

² Die Fonds wurden am 7. November 2018 aufgelegt.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

A. Grundlage der Erstellung und Entsprechens-Erklärung

Der ungeprüfte Halbjahresabschluss für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 wurde gemäß dem International Accounting Standard („IAS“) 34 „Zwischenberichterstattung“ und den irischen Gesetzen, insbesondere den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 in ihrer jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) sowie den Vorschriften des Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Abschnitt 48(1)) betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren von 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) erstellt. Der verkürzte, ungeprüfte Halbjahresabschluss sollte zusammen mit dem Jahresbericht und dem geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 gelesen werden, die gemäß den International Financial Reporting Standards, wie sie in der Europäischen Union anzuwenden sind („EU-IFRS“) und irischem Recht einschließlich des Companies Act 2014, den OGAW-Vorschriften und den OGAW-Vorschriften der Zentralbank erstellt wurden.

Für diesen ungeprüften Halbjahresabschluss wurden dieselben Bilanzierungsgrundsätze sowie dieselbe Darstellung und dieselben Berechnungsmethoden angewendet, wie bei der Erstellung des Jahresberichts und des geprüften Jahresabschlusses der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019.

B. Neue Standards, Änderungen und Auslegungen mit Wirkung vom 1. Juli 2019

IFRIC 23 wird wirksam für jährliche Zeiträume, die am oder nach dem 1. Januar 2019 beginnen, und stellt klar, wie die Vorschriften zu Ansatz und Bewertung von IAS 12, Ertragsteuern, anzuwenden sind, wenn Unsicherheit bezüglich der ertragsteuerlichen Behandlung besteht. Die Anwendung des Standards hat keine wesentlichen Auswirkungen auf den Abschluss der Gesellschaft.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

| | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 |
|--|--|--|--|--|--|--|---|--|
| | 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 UCITS ETF |
| | \$ | \$ | € | € | \$ | £ | £ | \$ |
| Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten | 709.942 | – | 420 | (1.986) | 417.633 | 1.519 | 3.550 | 41.156 |
| Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften | 9.212.339 | – | (57.168) | (152.027) | 5.634.350 | 25.211 | 48.641 | 528.946 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 56.323.495 | (194.655) | (3.466) | (8.199) | – | – | – | – |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten | 14.447.128 | – | 4.065.318 | (15.309.560) | 11.430.833 | 1.128.419 | (845.328) | 3.889.971 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen | (50.260) | (1.736) | – | – | – | – | – | – |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 122.415.202 | 1.825.071 | (56) | (569) | – | – | – | – |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten | 14.867.256 | – | (483.417) | 1.202.644 | 1.350.020 | (106.831) | 143.490 | (214.810) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen | 28.237 | 1.504 | – | – | – | – | – | – |
| | 217.953.339 | 1.630.184 | 3.521.631 | (14.269.697) | 18.832.836 | 1.048.318 | (649.647) | 4.245.263 |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

| | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 |
|--|--|--|---|--|--|---|--|--|
| | 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 |
| | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ |
| Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten | 175.559 | 20.312 | – | – | 43.967 | 6.667 | – | – |
| Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften | 2.315.960 | 243.583 | – | – | 539.365 | 89.254 | – | – |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | – | – | 10.841.706 | 41.992.818 | 1.332.951 | 534.379 | (996.966) | 80.411 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten | 16.390.561 | (4.391.489) | (53.917) | (5.351) | (599.212) | (99.379) | (14.486) | 4.680 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen | – | – | 8.492 | (14.248) | – | – | 10.728 | (3.771) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | – | – | 38.396.763 | 6.870.721 | – | – | 4.812.787 | 330.047 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten | 11.031.789 | 1.976.632 | (17.337) | 177 | 26.752 | (131.104) | 807 | (5) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen | – | – | 16.825 | 8.116 | – | – | (514) | – |
| | 29.913.869 | (2.150.962) | 49.192.532 | 48.852.233 | 1.343.823 | 399.817 | 3.812.356 | 411.362 |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

| | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 |
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| | L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF | L&G US Equity UCITS ETF ¹ | L&G UK Equity UCITS ETF ¹ | L&G Japan Equity UCITS ETF ¹ | 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 ¹ |
| | \$ | \$ | £ | \$ | \$ | € | \$ | \$ |
| Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten | – | – | – | – | – | – | – | – |
| Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften | – | – | – | – | – | – | – | – |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 70.229 | 286.872 | 1.197 | 320.543 | 26.817 | 609.591 | (16.979) | 16.660 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten | 827 | – | (20) | 1.784 | (47) | (6.115) | 33.854 | (147) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen | (1.458) | – | (1.030) | (13.529) | 123 | 5.769 | (34.452) | 98 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 430.581 | 11.552.712 | 100.134 | 9.936.754 | 2.344.622 | 7.063.775 | 126.441 | 230.160 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten | – | – | – | – | – | – | – | – |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen | (2) | – | (127) | 1.229 | 254 | 514 | (425) | 57 |
| | 500.177 | 11.839.584 | 100.154 | 10.246.781 | 2.371.769 | 7.673.534 | 108.439 | 246.828 |

¹ Der Fonds wurde am 25. Juni 2019 aufgelegt.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

| | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2019 |
|--|--|--|--|--|
| | L&G Artificial Intelligence UCITS ETF ¹ | L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF ¹ | L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ² | L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ³ |
| | \$ | \$ | € | \$ |
| Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten | – | – | – | – |
| Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften | – | – | – | – |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 51.788 | 67.476 | 750.347 | 414.738 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten | 26 | 30 | (11.786) | – |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen | (136) | (30) | (4.925) | – |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | 121.852 | 108.459 | 17.711.020 | 17.780.798 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten | – | – | – | – |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen | – | 1 | 707 | – |
| | 173.530 | 175.936 | 18.445.363 | 18.195.536 |

¹ Die Fonds wurden am 26. Juni 2019 aufgelegt.

² Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

³ Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

| | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 |
|--|--|--|--|--|--|--|---|--|
| | 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 UCITS ETF |
| | \$ | \$ | € | € | \$ | £ | £ | \$ |
| Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten | 8.697.341 | – | (5.105) | (1.275) | 591.389 | 2.182 | 4.511 | 54.879 |
| Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften | 11.003.648 | – | (54.331) | (126.800) | 7.963.920 | – | – | 564.558 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 21.038.948 | (1.594.002) | (5.310) | (16.712) | – | – | – | – |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten | (85.787.614) | 1.014 | (11.360.943) | 23.901.128 | (76.920.929) | (1.856.544) | 2.987.496 | (12.925.622) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen | (14.330.143) | (13.062) | – | – | – | – | – | – |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | (316.783.489) | (2.099.611) | – | – | – | – | – | – |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten | (14.431.725) | – | 1.736.491 | (3.851.711) | (10.792.509) | (26.469) | 40.792 | 2.769.481 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen | 3.171.848 | 4.349 | – | – | – | – | – | – |
| | (387.421.186) | (3.701.312) | (9.689.198) | 19.904.630 | (79.158.129) | (1.880.831) | 3.032.799 | (9.536.704) |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

| | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 |
|--|--|--|---|--|--|---|---|--|
| | 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 LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ | L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ | L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ | L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ | L&G Cyber Security UCITS ETF |
| | \$ | \$ | \$ | € | \$ | \$ | \$ | \$ |
| Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten | 165.967 | 36.636 | – | 92.597 | 1.324.832 | 267.133 | 6.102.308 | – |
| Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften | 1.787.903 | 322.698 | – | – | – | – | – | – |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | – | – | 10.269.852 | (11.207) | (292.798) | (592.148) | (6.370.341) | 25.143.080 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten | (6.188.066) | (1.738.280) | (272.488) | – | (3.075.301) | (199.761) | 283.947 | (20.947) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen | – | – | 227.409 | – | 925.694 | (753.122) | (14.765.842) | 55.193 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | – | – | (225.421.694) | (161.216) | (926.963) | 587.712 | 5.203.527 | (81.593.584) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten | (832.256) | (1.302.757) | (11.498) | – | 29.686 | (122.125) | 85 | 3.167 |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen | – | – | 194.075 | – | (1.329.389) | (189.162) | 4.488.783 | 2.489 |
| | (5.066.452) | (2.681.703) | (215.014.344) | (79.826) | (3.344.239) | (1.001.473) | (5.057.533) | (56.410.602) |

¹Zwangsweise zurückgenommen am 28. Juni 2019. Die Vermögenswerte des Fonds wurden anschließend veräußert und die Erlöse in bar an diejenigen Personen ausgeschüttet, die am 28. Juni 2019 als Anteilhaber des Fonds registriert waren. Nach der Veröffentlichung des geprüften Jahresberichts und Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 wurde bei der Zentralbank ein Antrag auf Widerruf der Genehmigung dieses Fonds als OGAW gestellt.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

| | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 |
|--|--|---|--|--|--|--|--|--|
| | 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 | L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF | L&G US Equity UCITS ETF ¹ | L&G UK Equity UCITS ETF ¹ | L&G Japan Equity UCITS ETF ¹ |
| | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ | £ | \$ |
| Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten | 32.833 | 13.385 | – | – | – | – | – | – |
| Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften | 422.045 | 151.169 | – | – | – | – | – | – |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | (3.235.355) | (2.389.167) | (60.306) | 225.660 | (90.244) | (2.898) | 24.684 | 3.178 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten | (467.559) | (168.089) | 2.232 | (6.195) | (755) | – | 29 | (3) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen | – | – | (5.264) | 5.016 | 558 | – | (57) | (2.308) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | – | – | (3.993.031) | (1.070.666) | (682.703) | (1.819.130) | (315.218) | (1.087.619) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten | (1.320.550) | (434.420) | – | – | – | – | (35) | – |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen | – | – | 240 | 5 | 78 | – | 94 | 246 |
| | (4.568.586) | (2.827.122) | (4.056.129) | (846.180) | (773.066) | (1.822.028) | (290.503) | (1.086.506) |

¹ Die Fonds wurden am 7. November 2018 aufgelegt.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

| | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 | Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2018 |
|--|--|---|---|
| | L&G Global Equity UCITS ETF ¹ | L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF ¹ | L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF ¹ |
| | \$ | € | \$ |
| Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten | – | – | – |
| Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften | – | – | – |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen | 6.609 | 15.960 | 5.764 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten | 6 | 3 | (85) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen | (967) | (1.377) | (1.788) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen | (1.460.033) | (1.253.623) | (381.849) |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten | – | – | – |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen | 7 | (14) | 22 |
| | (1.454.378) | (1.239.051) | (377.936) |

¹ Die Fonds wurden am 7. November 2018 aufgelegt.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (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 einem Drittvergleich standhalten, 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 und Kontokorrentverbindlichkeiten

Die Barbestände und Kontokorrentverbindlichkeiten der Fonds, soweit vorhanden, werden bei The Bank of New York Mellon SA/NV gehalten.

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 einen gesperrten Barbetrag von 20.098 US\$ (30. Juni 2019: 20.383 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 den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

4. Zahlungsmittel und Kontokorrentverbindlichkeiten (Fortsetzung)

Die Gesellschaft führt Umbrella-„Sammelkonten“, 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 mehrere Sammelkonten eingerichtet (jeweils eins für jede von den Fonds der Gesellschaft genutzten Handelswährungen).

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 31. Dezember 2019 und zum 30. Juni 2019 aufgeführt:

| Fonds | Kontrahent | Beizulegender Zeitwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2019 | Beizulegender Zeitwert der Sicherheiten zum 31. Dezember 2019* | % der Position |
|---|----------------------------------|--|--|----------------|
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 22.709.130 € | 23.646.845 € | 104 % |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 63.314.000 € | 65.578.436 € | 104 % |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | Barclays Bank Plc | 563.767.449 \$ | 607.024.445 \$ | 108 % |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 9.959.000 £ | 10.265.675 £ | 103 % |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 11.828.751 £ | 12.215.363 £ | 103 % |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | Barclays Bank Plc | 57.709.750 \$ | 62.578.169 \$ | 108 % |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | Merrill Lynch International | 215.171.799 \$ | 232.109.899 \$ | 108 % |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 15.904.700 \$ | 16.605.321 \$ | 104 % |
| L&G All Commodities UCITS ETF | Barclays Bank Plc | 52.900.070 \$ | 57.634.194 \$ | 109 % |
| L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF | Barclays Bank Plc | 8.454.553 \$ | 9.212.082 \$ | 109 % |
| Insgesamt | | 1.039.330.822 \$ | 1.115.099.391 \$ | |

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

| Fonds | Kontrahent | Beizulegender Zeitwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019 | Beizulegender Zeitwert der Sicherheiten zum 30. Juni 2019* | % der Position |
|---|----------------------------------|--|--|----------------|
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 30.435.515 € | 31.200.644 € | 103 % |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 65.550.481 € | 66.906.951 € | 102 % |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | Barclays Bank Plc | 550.666.365 \$ | 581.684.950 \$ | 106 % |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 5.686.924 £ | 6.156.767 £ | 108 % |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 13.281.737 £ | 13.603.893 £ | 102 % |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | Barclays Bank Plc | 45.557.021 \$ | 49.524.840 \$ | 109 % |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | Merrill Lynch International | 195.643.135 \$ | 205.509.622 \$ | 105 % |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | Citigroup Global Markets Limited | 25.843.485 \$ | 26.380.829 \$ | 102 % |
| L&G All Commodities UCITS ETF | Barclays Bank Plc | 48.713.000 \$ | 52.952.613 \$ | 109 % |
| L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF | Barclays Bank Plc | 7.893.000 \$ | 8.627.697 \$ | 109 % |
| Insgesamt | | 1.007.764.308 \$ | 1.061.552.864 \$ | |

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

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

5. Sicherheiten (Fortsetzung)

(ii) Von Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten

| Von Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten | Merrill Lynch International Zum 31. Dezember 2019 | Citigroup Global Markets Limited Zum 31. Dezember 2019 | Barclays Bank Plc Zum 31. Dezember 2019 | Insgesamt Zum 31. Dezember 2019 |
|---|--|--|---|--|
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | – | 670.000 € | – | 670.000 € |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | – | – | 8.050.000 \$ | 8.050.000 \$ |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | – | 170.000 £ | – | 170.000 £ |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | 17.720.000 \$ | – | – | 17.720.000 \$ |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | – | 1.610.000 \$ | – | 1.610.000 \$ |
| L&G All Commodities UCITS ETF | – | – | 670.000 \$ | 670.000 \$ |
| Insgesamt | 17.720.000 \$ | 2.587.269 \$ | 8.720.000 \$ | 29.027.269 \$ |

| Von Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten | Merrill Lynch International Zum 30. Juni 2019 | Citigroup Global Markets Limited Zum 30. Juni 2019 | Barclays Bank Plc Zum 30. Juni 2019 | Insgesamt Zum 30. Juni 2019 |
|---|--|--|---|--------------------------------------|
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | – | 920.000 € | – | 920.000 € |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | – | – | 6.513.495 \$ | 6.513.495 \$ |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | 4.919.398 \$ | – | – | 4.919.398 \$ |
| L&G All Commodities UCITS ETF | – | – | 647.793 \$ | 647.793 \$ |
| L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF | – | – | 199.669 \$ | 199.669 \$ |
| Insgesamt | 4.919.398 \$ | 1.047.677 \$ | 7.360.957 \$ | 13.328.032 \$ |

(iii) Bei Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten

| Bei Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten | Merrill Lynch International Zum 31. Dezember 2019 | Citigroup Global Markets Limited Zum 31. Dezember 2019 | Barclays Bank Plc Zum 31. Dezember 2019 | Insgesamt Zum 31. Dezember 2019 |
|---|--|--|---|--|
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | – | 80.000 \$ | – | 80.000 £ |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | 270.000 \$ | – | – | 270.000 \$ |
| Insgesamt | 270.000 \$ | 105.980 \$ | – | 375.980 \$ |

| Bei Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten | Merrill Lynch International Zum 30. Juni 2019 | Citigroup Global Markets Limited Zum 30. Juni 2019 | Barclays Bank Plc Zum 30. Juni 2019 | Insgesamt Zum 30. Juni 2019 |
|---|--|--|---|--------------------------------------|
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | – | 500.000 € | – | 500.000 € |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | – | 87.000 £ | – | 87.000 £ |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | – | – | 1.339.941 \$ | 1.339.941 \$ |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | – | 890.738 \$ | – | 890.738 \$ |
| Insgesamt | – | 1.570.853 \$ | 1.339.941 \$ | 2.910.794 \$ |

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

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

6. Grundkapital

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

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

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

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 und dürfen nicht spekulativer Natur sein.

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 Berichtszeiträume zum 31. Dezember 2019 und zum 31. Dezember 2018 gab es keine Transaktionskosten in Verbindung mit dem Kauf- und Verkaufspreis von umgekehrten Pensionsgeschäften.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

7. Effizientes Portfoliomanagement (Fortsetzung)

Nachstehende Tabelle weist die Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften für die Berichtszeiträume zum 31. Dezember 2019 und zum 31. Dezember 2018 aus:

| Fonds | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 |
|---|--|--|
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | (57.168) € | (54.331) € |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | (152.027) € | (126.800) € |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | 5.634.350 \$ | 7.963.920 \$ |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | 25.211 £ | – £ |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | 48.641 £ | – £ |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | 528.946 \$ | 564.558 \$ |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | 2.315.960 \$ | 1.787.903 \$ |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | 243.583 \$ | 322.698 \$ |
| L&G All Commodities UCITS ETF | 539.365 \$ | 422.045 \$ |
| L&G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF | 89.254 \$ | 155.169 \$ |
| | 9.212.339 \$ | 11.003.648 \$ |

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

8. Wesentliche Vereinbarungen und Transaktionen mit verbundenen Parteien

Die Verwaltungsgesellschaft

Die Gesellschaft zahlt aus dem Vermögen der einzelnen Fonds eine feste Gesamtkostenquote („TER“) an die Verwaltungsgesellschaft auf Basis des Nettoinventarwertes 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 9 und 10 aufgeführt.

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

Die für die Verwaltungsgesellschaft anfallende Gebühr wird in der Gesamtergebnisrechnung berücksichtigt, und die am Ende des Geschäftsjahres zahlbare Gebühr ist unter den sonstigen Verbindlichkeiten in der Bilanz ausgewiesen.

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

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

Autorisierte Teilnehmer

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

- Barclays Capital Securities Limited
- Citigroup Global Markets Ltd
- Commerzbank AG
- Credit Suisse Securities (Europe) Limited
- Flow Traders B.V.
- HSBC Bank PLC
- Jane Street Financial Ltd
- Merrill Lynch International
- Morgan Stanley and Co. International PLC*
- Optiver V.O.F.
- Susquehanna International Securities
- Unicredit Bank A.G.*

* Neu autorisierte Teilnehmer seit dem 30. Juni 2019.

Beziehungen der Verwaltungsratsmitglieder

Herr Mark Weeks war ein nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft. Zuvor war er Chief Executive Officer von ETF Securities (UK) Limited. Herr Mark Weeks ist am 14. Januar 2020 als geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft zurückgetreten.

Herr Weeks erhielt ein Honorar von 10.000 € (31. Dezember 2018: 33.405 €) für die der Gesellschaft im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 erbrachten Dienste. Herr Weeks erhielt und erhält keine variable Vergütung.

Frau Amy Ellison wurde am 29. März 2019 zum Verwaltungsratsmitglied ernannt und ist ein nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft und der Gesellschaft.

Herr Adrian Waters und Frau Eimear Cowhey erhielten Bezüge von 15.000 € bzw. 12.500 € (31. Dezember 2018: 12.500 €) für die der Gesellschaft im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 erbrachten Dienste. Die Bezüge des Verwaltungsrats sind im Abschluss der LGIM ETF Managers Limited angegeben.

Abgesehen von Herrn Waters, Frau Cowhey und Herrn Weeks erhielt keines der anderen Verwaltungsratsmitglieder eine Vergütung für das Amt als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

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

Beziehungen der Verwaltungsratsmitglieder (Fortsetzung)

Der Verwaltungsrat und der Sekretär, die am 31. Dezember 2019 und 30. Juni 2019 im Amt waren, hatten zu diesem Zeitpunkt oder zu einem Zeitpunkt während des aktuellen oder vorherigen Berichtszeitraums keinen Anteil an den Anteilen der Gesellschaft; auch ihre Familien hatten zum 31. Dezember 2019 und 30. Juni 2019 oder zu einem Zeitpunkt während des aktuellen oder vorherigen Berichtszeitraums keinen Anteil an den Anteilen der Gesellschaft.

Sämtliche Transaktionen zwischen verbundenen Parteien erfolgen nach dem Fremdvergleichsgrundsatz.

Alle Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind auch Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft.

Nahestehende Personen

Gemäß den Anforderungen in Kapitel 10 der OGAW-Vorschriften der Zentralbank müssen 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.

Der Verwaltungsrat hat sich vergewissert, dass Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die vorstehend aufgeführten Verpflichtungen für alle Transaktionen mit nahestehenden Personen gelten und dass die im aktuellen oder vorherigen Berichtszeitraum eingegangenen Transaktionen mit nahestehenden Personen die oben dargelegten Verpflichtungen einhalten.

9. Betriebliche Aufwendungen

Gemäß dem Verwahrstellenvertrag zwischen der Gesellschaft, der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle vom 15. September 2016 erbringt die Verwahrstelle verschiedene Verwahrdienste und zusätzliche Dienstleistungen für die Gesellschaft. Im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistungen werden verschiedene Gebühren erhoben. Die Gebühren beziehen sich auf Übertragungen, u. a. sowohl Barübertragungen als auch Wertpapierabwicklungen. Zusätzlich zu den sich auf Übertragungen beziehenden Gebühren werden auch Verwahrstellengebühren (als Prozentsatz des verwalteten Vermögens) in Rechnung gestellt. Auch wenn die Verwahrstelle direkt von der Gesellschaft ernannt wurde, so werden ihre Gebühren (mit Ausnahme der Gebühren für Portfoliotransaktionen, die direkt dem entsprechenden Fonds in Rechnung gestellt werden), von der Verwaltungsgesellschaft aus den TER gezahlt, die er von der Gesellschaft erhält.

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

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

9. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

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 Transferstelle der Gesellschaft ernannt und ihr die Verantwortung für die tägliche Verwaltung der Gesellschaft übertragen. Hierzu gehört auch die Berechnung des Nettoinventarwertes und des Nettoinventarwertes 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 Gebühr des Anlageverwalters und der Untieranlageverwalter wird aus der TER gezahlt, welche die Verwaltungsgesellschaft 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 Nettoinventarwertes 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 einbezogen werden.

10. 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-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 Fonds für die Berichtszeiträume zum 31. Dezember 2019 und 31. Dezember 2018 aufgeführt:

| Fonds | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 |
|---|--|--|
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | (69.006) € | (85.897) € |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | 75.450 € | (30.133) € |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | (6.289.733) \$ | (8.839.878) \$ |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | (76.851) £ | (75.872) £ |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | (68.062) £ | (76.787) £ |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | (473.467) \$ | (573.435) \$ |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | (3.063.458) \$ | (2.436.823) \$ |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | (365.481) \$ | (486.092) \$ |
| L&G All Commodities UCITS ETF | (599.212) \$ | (467.559) \$ |
| L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF | (99.379) \$ | (168.089) \$ |
| Insgesamt | (11.066.129) \$ | (25.353.981) \$ |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. 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 Währungsrisiko, dem Zinsrisiko und dem Preisrisiko zusammensetzt), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko, die in dieser Anmerkung erläutert werden.

Das globale Gesamtrisiko wird mittels des Commitment-Ansatzes im Zusammenhang für Fonds mit physischer Nachbildung und mit dem relativen Value-at-Risk-Ansatz für Fonds mit synthetischer Nachbildung („relativer VaR-Ansatz“) berechnet, wie in Anmerkung 11.5 (*Gesamtrisiko*) *genauer erörtert*.

Die Verwaltungsgesellschaft hat gemäß einem Anlageverwaltungsvertrag die Anlageverwaltungstätigkeiten (d. h. die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte der Gesellschaft) an den 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 den Anlageverwalter übertragen. Im Zusammenhang mit Fonds mit physischer Nachbildung hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungstätigkeiten (d. h. die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte der Fonds mit physischer Nachbildung) mit Ausnahme des L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF, des L&G Cyber Security UCITS ETF, des L&G Battery Value-Chain UCITS ETF, des L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF, des L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF, des L&G US Equity UCITS ETF, des L&G UK Equity UCITS ETF, des L&G Japan Equity UCITS ETF, des L&G Global Equity UCITS ETF, des L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF, des L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF, des L&G Clean Water UCITS ETF, des L&G Artificial Intelligence UCITS ETF, des L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF, des L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF und des L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF an die jeweiligen Unteranlageverwalter unterdelegiert.

Der Anlageverwalter ist gegenüber der Verwaltungsgesellschaft und letztendlich gegenüber dem Verwaltungsrat der Gesellschaft für die Anlageverwaltung der Vermögenswerte der Gesellschaft verantwortlich.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. 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 Prospektnachträge (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 vom Anlageverwalter, 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, der Registerstelle 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 emittierten wurden, auf RMB lauten und in RMB an den Börsen in Shenzhen und Schanghai gehandelt werden.

Darüber hinaus setzt der 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 setzt der Unteranlageverwalter ein Risikomanagementprogramm in Bezug auf Anlagen der Gesellschaft in börsengehandelten Terminkontrakten (Futures) ein. Der L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF hielt im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 keine Anlagen in Futures. Die zuvor erwähnten Risikomanagementprogramme werden vom Anlageverwalter und vom Unteranlageverwalter eingesetzt, um die Risiken im Zusammenhang mit Anlagen der Fonds in die jeweiligen Arten derivativer Finanzinstrumente zu managen und zu überwachen.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. 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 Währungsrisiko, das Zinsrisiko und das Preis-/Kursrisiko 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.

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, protektionistischen Handelsbestimmungen oder Marktliberalisierungen, Umweltveränderungen, Agrar-, Steuer-, geldpolitischen und Devisenkontrollprogrammen und politischen Entscheidungen von Regierungen (einschließlich der staatlichen Intervention in bestimmten Märkten).

(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.

(iii) Zinsrisiko

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

Das Zinsrisiko eines jeden Fonds wurde von den Untieranlageverwaltern in Übereinstimmung mit den Zielen und der Strategie, wie sie im Verkaufsprospekt des Fonds festgelegt sind, und den bestehenden Verfahrensweisen gesteuert. Nach Auffassung des Anlageverwalters besteht für die Fonds mit physischer Nachbildung ein minimales Zinsrisiko, da sich das Risiko auf Bankguthaben beschränkt.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Kreditrisiko

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

(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.

Für Fonds mit physischer Nachbildung (mit Ausnahme des L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF) kann die Gesellschaft nach Ermessen des Untermanagers 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 Registerstelle und anderen Verwahrstellen – Dividenden und Liquidationsgelder von Fonds

Die Registerstelle ist dafür zuständig, an den jeweiligen Zahlungsterminen die Zahlungen an Anteilinhaber in Bezug auf (i) Dividendengelder für diejenigen Fonds, die von Zeit zu Zeit Ausschüttungen tätigen, und (ii) die Erlöse von Zwangsrücknahmen eines Fonds (d. h. Auflösung) zu veranlassen. Diese Zahlungen erfolgen allesamt über CREST, bei dem es sich um ein anerkanntes, computergestütztes Clearing- und Abrechnungssystem handelt, das den Kauf und Verkauf von Anteilen der Fonds auf dem Sekundärmarkt ermöglicht und aufzeichnet. Vor dem jeweiligen Zahlungstermin werden die Gelder zur Ausschüttung an Anteilinhaber als Dividenden oder die Erlöse einer Zwangsrücknahme vom Verwalter von den vom Verwalter verwalteten Sammelkonten auf die von der Registerstelle eröffneten und verwalteten Kundenkonten überwiesen. Im Zeitraum, in dem diese Gelder auf den Kundenkonten gehalten werden, ist die Gesellschaft in Bezug auf diese Gelder gegenüber der Registerstelle und jeder Depotbank einem Kreditrisiko ausgesetzt, bei der die Registerstelle diese Kundenkonten zugunsten der Gesellschaft unterhält.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

2. Fonds mit physischer Nachbildung (Fortsetzung)

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 Nettoinventarwert 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 Nettoinventarwertes 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.

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;
- 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 die Ausgabe oder Rücknahme von Anteilen eines OTC-Swaps mit dem Kontrahenten 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 Wertes 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.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

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

- 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.
- 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 Glattstellung einer Position eines OTC-Swaps, der eingesetzt wird, um einen Index nachzubilden, kann unter diesen Umständen anstelle des tatsächlichen Wertes 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 Anteilhaber ändern (möglicherweise auch reduzieren).

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko

Das Marktrisiko ist das Risiko, dass der Wert von gehaltenen Instrumenten aufgrund von Veränderungen der Marktpreise, die durch das Währungsrisiko, das Zinsrisiko und das Preis-/Kursrisiko 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“).

Dies bedeutet, dass der Fonds darauf abzielt, für seine Anteilinhaber eine gehebelte Rendite zu erzielen, die der doppelten täglichen prozentualen Veränderung des Basisindex 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 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.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(i) Preisrisiko (Fortsetzung)

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 Entleihung 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 entspricht (vor Anpassung um den in die gehebelte Methodik eingebetteten Tagesgeldsatz und die eingebetteten Kreditkosten und um 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 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.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

B. Marktrisiko (Fortsetzung)

(i) Preisrisiko (Fortsetzung)

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 Index | FTSE 100® Total Return Declared Dividend Index |

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 haben im Berichtszeitraum OTC-Swaps gehalten, 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. Der Anlageverwalter ist 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 Untieranlageverwaltern in Übereinstimmung mit den Zielen und der Strategie, wie sie im Verkaufsprospekt des Fonds festgelegt sind, und den bestehenden Verfahrensweisen gesteuert.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. 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 regelmäßig umgekehrte Pensionsgeschäfte abgeschlossen haben, besteht ein Kreditrisiko durch die Parteien, mit denen diese Geschäfte getätigt werden.

(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 Berichtszeitraum 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, anders als es bei einem „funded“ Swap der Fall wäre, nicht auf die Swap-Kontrahenten übertragen). Der Anlageverwalter verwaltet 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 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“)). Die 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 den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. 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 werden im vom Anlageverwalter 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 709.942 US\$ für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (31. Dezember 2018: 896.405 US\$) und werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

Der Anlageverwalter wendet 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 31. Dezember 2019 und 30. Juni 2019 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 vom Anlageverwalter im Rahmen der täglichen Überwachung von Transaktionen mit den Kontrahenten eingesetzten Verfahren prüft der Anlageverwalter fortlaufend die Liste der Kontrahenten, um sicherzustellen, dass keine wesentlichen Probleme vorliegen, die die Fähigkeit der Kontrahenten zur Erfüllung ihrer Verpflichtungen beeinträchtigen könnten.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

C. Kreditrisiko (Fortsetzung)

(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019 hielten die Fonds Einschusszahlungen, Barbestände, Geldmarktinstrumente, umgekehrte Pensionsgeschäfte bzw. OTC-Swaps wie nachstehend angegeben:

| Fonds | Bank of New York Mellon 30. Juni 2019 | % des Nettovermögens | Merrill Lynch International 30. Juni 2019 | % des Nettovermögens | Citigroup Global Markets Limited 30. Juni 2019 | % des Nettovermögens | Barclays Bank Plc 30. Juni 2019 | % des Nettovermögens |
|------------------|--|----------------------|--|----------------------|---|----------------------|------------------------------------|----------------------|
| Insgesamt | 113.505.219 \$ | 3 % | 273.209.157 \$ | 6 % | 141.018.031 \$ | 3 % | 621.837.630 \$ | 14 % |

Zum 30. Juni 2019 hielten die Fonds Einschusszahlungen, Barbestände, Geldmarktinstrumente, umgekehrte Pensionsgeschäfte bzw. OTC-Swaps wie nachstehend angegeben:

| Fonds | Bank of New York Mellon 30. Juni 2019 | % des Nettovermögens | Merrill Lynch International 30. Juni 2019 | % des Nettovermögens | Citigroup Global Markets Limited 30. Juni 2019 | % des Nettovermögens | Barclays Bank Plc 30. Juni 2019 | % des Nettovermögens |
|------------------|--|----------------------|--|----------------------|---|----------------------|------------------------------------|----------------------|
| Insgesamt | 78.866.218 \$ | 2 % | 197.563.358 \$ | 6 % | 159.150.308 \$ | 5 % | 651.119.268 \$ | 19 % |

(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 Registerstelle und anderen Verwahrstellen – Dividenden und Liquidationsgelder von Fonds

Die Registerstelle ist dafür zuständig, an den jeweiligen Zahlungsterminen die Zahlungen an Anteilinhaber in Bezug auf (i) Dividendengelder für diejenigen Fonds, die von Zeit zu Zeit Ausschüttungen tätigen, und (ii) die Erlöse von Zwangsrücknahmen eines Fonds (d. h. Auflösung) zu veranlassen. Diese Zahlungen erfolgen allesamt über CREST, bei dem es sich um ein anerkanntes, computergestütztes Clearing- und Abrechnungssystem handelt, das den Kauf und Verkauf von Anteilen der Fonds auf dem Sekundärmarkt ermöglicht und aufzeichnet. Vor dem jeweiligen Zahlungstermin werden die Gelder zur Ausschüttung an Anteilinhaber als Dividenden oder die Erlöse einer Zwangsrücknahme vom Verwalter von den vom Verwalter verwalteten Sammelkonten auf die von der Registerstelle eröffneten und verwalteten Kundenkonten überwiesen. Im Zeitraum, in dem diese Gelder auf den Kundenkonten gehalten werden, ist die Gesellschaft in Bezug auf diese Gelder gegenüber der Registerstelle und jeder Depotbank einem Kreditrisiko ausgesetzt, bei der die Registerstelle diese Kundenkonten zugunsten der Gesellschaft unterhält.

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 den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

3. Fonds mit synthetischer Nachbildung (Fortsetzung)

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 Anteilhaber der Gesellschaft können ihre Anteile an jedem Geschäftstag gegen eine Barzahlung in Höhe des Anteils am Nettoinventarwert 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 Nettoinventarwertes 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.

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 ist diese Zeitwertbewertung der Ebene 3 zuzuordnen. 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.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

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

(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, der Verwahrstelle, gehalten. Zum 31. Dezember 2019 hielt kein Fonds mehr als 15 %* (30. Juni 2019: 16 %*) 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

| 31. Dezember 2019 | Währung | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Insgesamt |
|--|---------|----------------------|----------------------|---------|----------------------|
| Insgesamt | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 113.309.661 | – | – | 113.309.661 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 25.892.341 | – | 25.892.341 |
| Stammaktien | | 3.321.537.765 | – | – | 3.321.537.765 |
| Bezugsrechte | | 7.568 | – | – | 7.568 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 1.039.330.822 | – | 1.039.330.822 |
| | | 3.434.854.994 | 1.065.223.163 | – | 4.500.078.157 |
| L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 26.357.517 | – | – | 26.357.517 |
| Bezugsrechte | | 7.568 | – | – | 7.568 |
| | | 26.365.085 | – | – | 26.365.085 |
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | € | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 1.702.091 | – | – | 1.702.091 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 22.709.130 | – | 22.709.130 |
| | | 1.702.091 | 22.709.130 | – | 24.411.221 |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| 31. Dezember 2019 | Währung | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Insgesamt |
|--|---------|--------------------|--------------------|----------|--------------------|
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | € | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 4.600.669 | – | – | 4.600.669 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 665.317 | – | 665.317 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 63.314.000 | – | 63.314.000 |
| | | 4.600.669 | 63.979.317 | – | 68.579.986 |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 60.162.161 | – | – | 60.162.161 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 5.024.747 | – | 5.024.747 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 563.767.449 | – | 563.767.449 |
| | | 60.162.161 | 568.792.196 | – | 628.954.357 |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | £ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 543.381 | – | – | 543.381 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 9.959.000 | – | 9.959.000 |
| | | 543.381 | 9.959.000 | – | 10.502.381 |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | £ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 890.727 | – | – | 890.727 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 118.088 | – | 118.088 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 11.828.751 | – | 11.828.751 |
| | | 890.727 | 11.946.839 | – | 12.837.566 |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 4.163.344 | – | – | 4.163.344 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 57.709.750 | – | 57.709.750 |
| | | 4.163.344 | 57.709.750 | – | 61.873.094 |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 32.762.553 | – | – | 32.762.553 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 17.871.410 | – | 17.871.410 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 215.171.799 | – | 215.171.799 |
| | | 32.762.553 | 233.043.209 | – | 265.805.762 |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 2.902.430 | – | – | 2.902.430 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 1.682.131 | – | 1.682.131 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 15.904.700 | – | 15.904.700 |
| | | 2.902.430 | 17.586.831 | – | 20.489.261 |
| L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 879.140.968 | – | – | 879.140.968 |
| | | 879.140.968 | – | – | 879.140.968 |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| 31. Dezember 2019 | Währung | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Insgesamt |
|--|---------|----------------------|-------------------|----------|----------------------|
| L&G Cyber Security UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 1.063.937.491 | – | – | 1.063.937.491 |
| | | 1.063.937.491 | – | – | 1.063.937.491 |
| L&G All Commodities UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 3.655.846 | – | – | 3.655.846 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 369.464 | – | 369.464 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 52.900.070 | – | 52.900.070 |
| | | 3.655.846 | 53.269.534 | – | 56.925.380 |
| L&G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 688.775 | – | – | 688.775 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 41.347 | – | 41.347 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 8.454.553 | – | 8.454.553 |
| | | 688.775 | 8.495.900 | – | 9.184.675 |
| L&G Battery Value–Chain UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 51.470.879 | – | – | 51.470.879 |
| | | 51.470.879 | – | – | 51.470.879 |
| L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 8.234.283 | – | – | 8.234.283 |
| | | 8.234.283 | – | – | 8.234.283 |
| L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 7.646.854 | – | – | 7.646.854 |
| | | 7.646.854 | – | – | 7.646.854 |
| L&G US Equity UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 138.835.416 | – | – | 138.835.416 |
| | | 138.835.416 | – | – | 138.835.416 |
| L&G UK Equity UCITS ETF | £ | | | | |
| Stammaktien | | 9.942.881 | – | – | 9.942.881 |
| | | 9.942.881 | – | – | 9.942.881 |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| 31. Dezember 2019 | Währung | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Insgesamt |
|---|---------|--------------------|----------|----------|--------------------|
| L&G Japan Equity UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 115.361.098 | – | – | 115.361.098 |
| | | 115.361.098 | – | – | 115.361.098 |
| L&G Global Equity UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 31.863.399 | – | – | 31.863.399 |
| | | 31.863.399 | – | – | 31.863.399 |
| L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF | € | | | | |
| Stammaktien | | 102.876.109 | – | – | 102.876.109 |
| | | 102.876.109 | – | – | 102.876.109 |
| L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 36.054.751 | – | – | 36.054.751 |
| | | 36.054.751 | – | – | 36.054.751 |
| L&G Clean Water UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 2.801.585 | – | – | 2.801.585 |
| | | 2.801.585 | – | – | 2.801.585 |
| L&G Artificial Intelligence UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 3.642.744 | – | – | 3.642.744 |
| | | 3.642.744 | – | – | 3.642.744 |
| L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 2.697.523 | – | – | 2.697.523 |
| | | 2.697.523 | – | – | 2.697.523 |
| L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF¹ | € | | | | |
| Stammaktien | | 226.952.836 | – | – | 226.952.836 |
| | | 226.952.836 | – | – | 226.952.836 |
| L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF² | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 570.095.282 | – | – | 570.095.282 |
| | | 570.095.282 | – | – | 570.095.282 |

¹ Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

² Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| 30. Juni 2019 | Währung | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Insgesamt |
|--|---------|----------------------|----------------------|----------|----------------------|
| Insgesamt | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 68.094.114 | – | – | 68.094.114 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 11.424.591 | – | 11.424.591 |
| Stammaktien | | 2.319.175.457 | – | – | 2.319.175.457 |
| Bezugsrechte | | 22.422 | – | – | 22.422 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 1.007.764.308 | – | 1.007.764.308 |
| | | 2.387.291.993 | 1.019.188.899 | – | 3.406.480.892 |
| L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 23.928.786 | – | – | 23.928.786 |
| | | 23.928.786 | – | – | 23.928.786 |
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | € | | | | |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 228.795 | – | 228.795 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 30.435.515 | – | 30.435.515 |
| | | – | 30.664.310 | – | 30.664.310 |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | € | | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 65.550.481 | – | 65.550.481 |
| | | – | 65.550.481 | – | 65.550.481 |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 43.868.974 | – | – | 43.868.974 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 3.674.727 | – | 3.674.727 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 550.666.365 | – | 550.666.365 |
| | | 43.868.974 | 554.341.092 | – | 598.210.066 |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | £ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 431.248 | – | – | 431.248 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 10.627 | – | 10.627 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 5.686.924 | – | 5.686.924 |
| | | 431.248 | 5.697.551 | – | 6.128.799 |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | £ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 975.133 | – | – | 975.133 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 13.281.737 | – | 13.281.737 |
| | | 975.133 | 13.281.737 | – | 14.256.870 |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 2.126.977 | – | – | 2.126.977 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 121.008 | – | 121.008 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 45.557.021 | – | 45.557.021 |
| | | 2.126.977 | 45.678.029 | – | 47.805.006 |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| 30. Juni 2019 | Währung | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Insgesamt |
|--|---------|-------------|-------------|---------|-------------|
| L&G Gold Mining UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 13.401.929 | – | – | 13.401.929 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 6.839.621 | – | 6.839.621 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 195.643.135 | – | 195.643.135 |
| | | 13.401.929 | 202.482.756 | – | 215.884.685 |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 1.549.273 | – | – | 1.549.273 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 25.843.485 | – | 25.843.485 |
| | | 1.549.273 | 25.843.485 | – | 27.392.758 |
| L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 931.605.800 | – | – | 931.605.800 |
| | | 931.605.800 | – | – | 931.605.800 |
| L&G Cyber Security UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 911.625.932 | – | – | 911.625.932 |
| | | 911.625.932 | – | – | 911.625.932 |
| L&G All Commodities UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 4.624.037 | – | – | 4.624.037 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 342.712 | – | 342.712 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 48.713.000 | – | 48.713.000 |
| | | 4.624.037 | 49.055.712 | – | 53.679.749 |
| L&G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF | \$ | | | | |
| Geldmarktinstrumente | | 733.023 | – | – | 733.023 |
| Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | 172.451 | – | 172.451 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | – | 7.893.000 | – | 7.893.000 |
| | | 733.023 | 8.065.451 | – | 8.798.474 |
| L&G Battery Value–Chain UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 46.988.976 | – | – | 46.988.976 |
| | | 46.988.976 | – | – | 46.988.976 |
| L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 7.841.435 | – | – | 7.841.435 |
| | | 7.841.435 | – | – | 7.841.435 |
| L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 4.712.300 | – | – | 4.712.300 |
| | | 4.712.300 | – | – | 4.712.300 |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| 30. Juni 2019 | Währung | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Insgesamt |
|---|---------|--------------------|----------|----------|--------------------|
| L&G US Equity UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 112.408.028 | – | – | 112.408.028 |
| | | 112.408.028 | – | – | 112.408.028 |
| L&G UK Equity UCITS ETF | £ | | | | |
| Stammaktien | | 9.606.775 | – | – | 9.606.775 |
| | | 9.606.775 | – | – | 9.606.775 |
| L&G Japan Equity UCITS ET | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 93.180.252 | – | – | 93.180.252 |
| | | 93.180.252 | – | – | 93.180.252 |
| L&G Global Equity UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 28.130.113 | – | – | 28.130.113 |
| Bezugsrechte | | 884 | – | – | 884 |
| | | 28.130.997 | – | – | 28.130.997 |
| L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF | € | | | | |
| Stammaktien | | 100.109.611 | – | – | 100.109.611 |
| Bezugsrechte | | 18.913 | – | – | 18.913 |
| | | 100.128.524 | – | – | 100.128.524 |
| L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 26.517.762 | – | – | 26.517.762 |
| | | 26.517.762 | – | – | 26.517.762 |
| L&G Clean Water UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 2.019.176 | – | – | 2.019.176 |
| | | 2.019.176 | – | – | 2.019.176 |
| L&G Artificial Intelligence UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 1.972.857 | – | – | 1.972.857 |
| | | 1.972.857 | – | – | 1.972.857 |
| L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF | \$ | | | | |
| Stammaktien | | 2.014.722 | – | – | 2.014.722 |
| | | 2.014.722 | – | – | 2.014.722 |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| 31. Dezember 2019 | Währung | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Insgesamt |
|---|---------|---------|------------------|---------|------------------|
| Insgesamt | \$ | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | (507.056) | – | (507.056) |
| | | – | (507.056) | – | (507.056) |
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | € | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | (254.622) | – | (254.622) |
| | | – | (254.622) | – | (254.622) |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | £ | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | (96.204) | – | (96.204) |
| | | – | (96.204) | – | (96.204) |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | \$ | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | (93.802) | – | (93.802) |
| | | – | (93.802) | – | (93.802) |

| 30. Juni 2019 | Währung | Ebene 1 | Ebene 2 | Ebene 3 | Insgesamt |
|--|---------|---------|------------------|---------|------------------|
| Insgesamt | \$ | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | (938.727) | – | (938.727) |
| | | – | (938.727) | – | (938.727) |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | € | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | (537.327) | – | (537.327) |
| | | – | (537.327) | – | (537.327) |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | £ | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | (25.402) | – | (25.402) |
| | | – | (25.402) | – | (25.402) |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | \$ | | | | |
| Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen | | – | (294.501) | – | (294.501) |
| | | – | (294.501) | – | (294.501) |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 haben keine Übertragungen von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten zwischen Ebene 1 und Ebene 2 sowie zwischen Ebene 2 und Ebene 3 der Zeitwerthierarchie stattgefunden. Es haben keine Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1 sowie von der Ebene 1 in die Ebene 3 stattgefunden.

Ein Vergleich der Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts von Finanzanlagen der Ebene 3 zwischen dem Beginn und dem Ende des Berichtszeitraums erfolgt nachstehend. Der L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF war der einzige Fonds, für den zum 30. Juni 2019 eine Abstimmung erforderlich war. 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 2019 | Stammaktien US\$ | Gesamt US\$ |
|---|---------------------|----------------|
| Anfangsbestand | 726.258 | 726.258 |
| Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3 | – | – |
| Übertragungen von der Ebene 3 in die Ebene 1 | – | – |
| Käufe | – | – |
| Verkäufe | (496.324) | (496.324) |
| Realisierter Verlust | (229.934) | (229.934) |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/Verlustes | – | – |
| Schlussbestand | – | – |

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

Zum 31. Dezember 2019 und 30. Juni 2019 wurden keine Wertpapiere der Ebene 3 gehalten.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

11. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken (Fortsetzung)

5. Derivaterisiko

A. Gesamtrisiko

Im Zusammenhang mit dem L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF, dem L&G Cyber Security UCITS ETF, dem L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF, dem L&G Battery Value-Chain UCITS ETF, dem L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF, dem L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF, dem L&G US Equity UCITS ETF, dem L&G UK Equity UCITS ETF, dem L&G Japan Equity UCITS ETF, dem L&G Global Equity UCITS ETF, dem L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF, dem L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF, dem L&G Clean Water UCITS ETF, dem L&G Artificial Intelligence UCITS ETF, dem L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF, dem L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF und dem L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF wurde das globale 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 siebzehn 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 Nettoinventarwerts des Fonds übersteigen.

B. Value-at-Risk („VaR“)

Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 hat der Anlageverwalter bei der Ermittlung des Gesamtrisikos für alle verbleibenden 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 auf 100 % im Verhältnis zum Nettoinventarwert ausgerichtet. Die maximale Abweichung bis zum nächsten Perzentil wurde im Berichtszeitraum 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. Der ETF VaR 1D repräsentiert die tägliche Volatilität des Fonds-NIW im Verlauf des Geschäftsjahres und entspricht der Standardabweichung des Tagesertrags, ausgehend von einer Normalverteilung mit einem Konfidenzniveau von 99 %.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

12. 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 Berichtszeiträumen zum 31. Dezember 2019 und 31. Dezember 2018 zahlten die folgenden Fonds die folgenden Ausschüttungen.

| | 31. Dezember 2019 | 31. Dezember 2018 |
|---|-------------------|-------------------|
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | 894,547 \$ | 1.120.270 \$ |
| L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ | Nicht zutreffend | 136.814 € |
| L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF ¹ | Nicht zutreffend | 1.464.248 \$ |
| L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ | Nicht zutreffend | 153.405 \$ |
| L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF ¹ | Nicht zutreffend | 13.277.586 \$ |

¹ Zwangsweise zurückgekauft am 28. Juni 2019. Die Vermögenswerte des Fonds wurden anschließend veräußert und die Erlöse in bar an diejenigen Personen ausgeschüttet, die zum Registrierungsdatum am 28. Juni 2019 als Anteilhaber des Fonds registriert waren. Nach der Veröffentlichung des geprüften Jahresberichts und Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 wurde bei der Zentralbank ein Antrag auf Widerruf der Genehmigung dieses Fonds als OGAW gestellt.

Nach der Veröffentlichung des geprüften Jahresberichts und Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 wurde bei der Zentralbank ein Antrag auf Widerruf der Genehmigung dieses Fonds als OGAW gestellt.

13. Getrennte Haftung

Die Gesellschaft ist als Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen ihren Fonds strukturiert. Aufgrund irischen Rechts stehen die Vermögenswerte eines Fonds nicht zur Begleichung der Verbindlichkeiten eines anderen Fonds zur Verfügung (diese Bestimmung gilt auch im Falle der Insolvenz und ist allgemein verbindlich für Gläubiger). Ferner enthält gemäß irischem Recht jeder Vertrag, den die Gesellschaft für einen Fonds (oder mehrere Fonds) abschließt, eine Bestimmung, dass der Vertragspartner keinen Rückgriff auf die Vermögenswerte von Fonds außer dem bzw. den Fonds, für den bzw. die der Vertrag geschlossen wird, hat. Die indexbasierten OTC-Swaps, die die Fonds von Zeit zu Zeit eingehen, enthalten ebenfalls ausdrückliche Bestimmungen zum Grundsatz der getrennten Haftung nach irischem Recht.

Da die Gesellschaft jedoch ein einziges Rechtssubjekt ist, das in anderen Hoheitsgebieten tätig sein oder Vermögenswerte in seinem Namen halten oder Forderungen unterliegen kann, die diese Trennung nicht unbedingt anerkennen, bleibt, falls an einem Gerichtsstand außerhalb Irlands eine Schuld oder Verbindlichkeit eines Fonds gerichtlich gegen die Gesellschaft geltend gemacht wird, ein Risiko, dass in einem Hoheitsgebiet, in dem dieser Anspruch geltend gemacht wird, der Grundsatz der getrennten Haftung zwischen den Fonds nicht anerkannt wird und ein Gläubiger versuchen wird, Vermögenswerte eines Fonds zur Befriedigung einer Schuld oder Verbindlichkeit eines anderen Fonds beschlagnahmen oder pfänden zu lassen.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

14. Nettoinventarwert

Die folgende Tabelle fasst den Nettoinventarwert, die in Umlauf befindlichen Anteile und den NIW je Anteil zum 31. Dezember 2019 und 30. Juni 2019 zusammen:

| Fonds | Währung | NIW zum 31. Dezember 2019 Gesamt | Anteile im Umlauf | NIW zum 31. Dezember 2019 Je Anteil |
|---|---------|--|----------------------|---|
| L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF | US\$ | 26.585.586 | 1.730.000 | 15,3673 |
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | EUR | 24.145.034 | 75.067 | 321,6464 |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | EUR | 67.872.227 | 19.149.138 | 3,5444 |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | US\$ | 620.743.737 | 43.560.921 | 14,2500 |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | GBP | 10.228.813 | 30.125 | 339,5456 |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | GBP | 13.060.034 | 1.986.704 | 6,5737 |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | US\$ | 62.032.429 | 885.894 | 70,0224 |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | US\$ | 247.932.821 | 8.352.389 | 29,6840 |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | US\$ | 18.831.364 | 4.066.066 | 4,6313 |
| L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF | US\$ | 880.526.018 | 52.840.500 | 16,6638 |
| L&G Cyber Security UCITS ETF | US\$ | 1.066.618.054 | 64.103.776 | 16,6389 |
| L&G All Commodities UCITS ETF | US\$ | 56.248.973 | 5.556.310 | 10,1234 |
| L&G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF | US\$ | 9.182.006 | 791.187 | 11,6053 |
| L&G Battery Value–Chain UCITS ETF | US\$ | 51.647.739 | 5.810.000 | 8,8894 |
| L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF | US\$ | 8.245.506 | 800.000 | 10,3068 |
| L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF | US\$ | 7.658.083 | 750.000 | 10,2107 |
| L&G US Equity UCITS ETF | US\$ | 139.055.352 | 11.700.000 | 11,8850 |
| L&G UK Equity UCITS ETF | GBP | 9.975.767 | 900.000 | 11,0841 |
| L&G Japan Equity UCITS ETF | US\$ | 115.534.196 | 10.305.000 | 11,2114 |
| L&G Global Equity UCITS ETF | US\$ | 32.003.973 | 2.700.000 | 11,8533 |
| L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF | EUR | 102.980.452 | 8.750.000 | 11,7691 |
| L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF | US\$ | 36.168.748 | 3.100.000 | 11,6673 |
| L&G Clean Water UCITS ETF | US\$ | 2.809.589 | 250.000 | 11,2383 |
| L&G Artificial Intelligence UCITS ETF | US\$ | 3.646.433 | 350.000 | 10,4183 |
| L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF | US\$ | 2.695.179 | 250.000 | 10,7807 |
| L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ¹ | EUR | 227.110.144 | 20.200.000 | 11,2430 |
| L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF ² | US\$ | 570.800.125 | 54.800.000 | 10,4160 |

¹Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

²Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

14. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

| Fonds | Währung | NIW zum 30. Juni 2019 Gesamt | Anteile im Umlauf | NIW zum 30. Juni 2019 Je Anteil |
|---|---------|------------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF | US\$ | 24.200.731 | 1.680.000 | 14,4051 |
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | EUR | 33.421.191 | 116.791 | 286,1620 |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | EUR | 67.865.584 | 16.086.036 | 4,2190 |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | US\$ | 589.426.331 | 42.652.421 | 13,8190 |
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | GBP | 6.123.011 | 18.950 | 323,1140 |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | GBP | 14.304.835 | 1.985.569 | 7,2040 |
| L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | US\$ | 49.132.022 | 750.788 | 65,4410 |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | US\$ | 210.861.690 | 8.088.889 | 26,0680 |
| L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | US\$ | 29.450.762 | 5.598.066 | 5,2610 |
| L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF | US\$ | 932.283.312 | 59.440.500 | 15,6843 |
| L&G Cyber Security UCITS ETF | US\$ | 917.607.656 | 57.803.776 | 15,8745 |
| L&G All Commodities UCITS ETF | US\$ | 53.026.969 | 5.363.310 | 9,8870 |
| L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF | US\$ | 8.796.699 | 791.187 | 11,1180 |
| L&G Battery Value-Chain UCITS ETF | US\$ | 47.074.331 | 5.810.000 | 8,1022 |
| L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF | US\$ | 7.847.623 | 800.000 | 9,8095 |
| L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF | US\$ | 4.720.271 | 500.000 | 9,4405 |
| L&G US Equity UCITS ETF | US\$ | 112.727.997 | 10.500.000 | 10,7359 |
| L&G UK Equity UCITS ETF | GBP | 9.678.127 | 900.000 | 10,7534 |
| L&G Japan Equity UCITS ETF | US\$ | 93.322.079 | 9.250.000 | 10,0888 |
| L&G Global Equity UCITS ETF | US\$ | 28.203.854 | 2.600.000 | 10,8476 |
| L&G Europe ex UK Equity UCITS ET | EUR | 100.293.960 | 9.250.000 | 10,8425 |
| L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF | US\$ | 26.592.650 | 2.300.000 | 11,5620 |
| L&G Clean Water UCITS ETF | US\$ | 2.024.098 | 200.000 | 10,1204 |
| L&G Artificial Intelligence UCITS ETF | US\$ | 1.977.589 | 200.000 | 9,8879 |
| L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF | US\$ | 2.019.646 | 200.000 | 10,0982 |

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

15. Segmentberichterstattung

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 angegeben.

Geografische Angaben

Die Gesellschaft hat keine Vermögenswerte, die als langfristig einzustufen sind. 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. Die Einkünfte werden einem Land auf der Grundlage der Domizilierung des Emittenten des Instruments zugeordnet.

| | Vereinigtes Königreich | Rest Europas | Vereinigte Staaten | Japan | Rest der Welt | Insgesamt |
|---|---------------------------|--------------|--------------------|------------|---------------|-------------|
| | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ |
| Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 | | | | | | |
| Nettoertrag nach Segmenten* | 37.044.547 | 11.728.748 | 137.111.831 | 29.880.794 | 16.974.934 | 232.740.854 |

| | Vereinigtes Königreich | Rest Europas | Vereinigte Staaten | Japan | Rest der Welt | Insgesamt |
|---|---------------------------|--------------|--------------------|-----------|---------------|------------|
| | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ | \$ |
| Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018 | | | | | | |
| Nettoertrag nach Segmenten* | 12.674.912 | 2.309.773 | 3.912.333 | 3.458.753 | 7.169.315 | 29.525.086 |

* Einschließliche Dividendenerträgen und Zinserträgen/(-aufwendungen) (die im Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, erfasst werden).

Wichtige Kunden

Die Gesellschaft betrachtet die Inhaber von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen ihrer Fonds nicht als Kunden, da sie außer mit autorisierten Teilnehmern nicht direkt mit Anlegern handelt (d. h. die Gesellschaft erlaubt keine Zeichnungen und Rücknahmen von anderen Anlegern als autorisierten Teilnehmern). Die Gesellschaft behandelt jedoch die Inhaber von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen ihrer Fonds strikt im Sinne der Offenlegungsanforderungen bezüglich „wichtiger Kunden“ nach IFRS 8.34 als Kunden, weil sie auf die von den Vermögenswerten der einzelnen Fonds abgezogene TER zur Finanzierung des Betriebs des jeweiligen Fonds angewiesen ist.

Die Struktur des Anteilsbestands der Gesellschaft ist keiner wesentlichen Anteilinhaberkonzentration ausgesetzt. Zum 31. Dezember 2019 hielt kein im CREST-Anteilinhaberregister geführter Anteilinhaber mehr als 19 % (30. Juni 2019: 17 % des ausgegebenen Anteilskapitals der Gesellschaft. Diese Feststellung wurde getroffen unter Bezugnahme auf den Wert der Anteile, die von jedem im CREST-Anteilinhaberregister registrierten Anteilinhaber (in allen maßgeblichen Anteilklassen der Gesellschaft) als Prozentsatz des Gesamt-NIW der Gesellschaft (aus allen Anteilklassen der Gesellschaft) gehalten wurden.

Mangelnde Transparenz bezüglich der eigentlichen wirtschaftlichen Eigentümer

Da die Anteile der Gesellschaft am Aktienmarkt gehandelt werden, sind sie für ein oder mehrere Clearing- und Abrechnungssysteme (z. B. CREST und Euroclear) zugelassen, so dass sie elektronisch gehandelt werden können.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

15. Segmentberichterstattung (Fortsetzung)

Wichtige Kunden (Fortsetzung)

In der Regel erscheinen Endanleger, die Anteile an Börsen kaufen (d. h. die eigentlichen wirtschaftlichen Eigentümer) nicht im CREST-Anteilhaberregister. Dies liegt daran, dass sie ihre Anteile in der Regel über einen Intermediär (Makler/Nominee) halten, der an ihrer Stelle im CREST-Anteilhaberregister verzeichnet ist. So können beispielsweise im Vereinigten Königreich Barclays Stockbrokers und Hargreaves Lansdown im CREST-Anteilhaberregister für Tausende von wirtschaftlichen Eigentümern erscheinen. Es ist uns nicht möglich, die Endanleger zu identifizieren, da es sich bei diesen Informationen um vertrauliche Daten von Barclays Stockbrokers and Hargreaves Lansdown handeln würde.

Kaufen und verkaufen Endanleger ihre Anteile an Börsen, die statt CREST alternative Clearing- und Abrechnungssysteme verwenden (z. B. Deutsche Börse, Borsa Italiana, Euronext und SIX Swiss Exchange), werden diese Endanleger in einem weiteren Schritt aus dem CREST-Anteilhaberregister entfernt. Dies liegt daran, dass das jeweilige von einer bestimmten Börse genutzte Clearing- und Abrechnungssystem in der Regel im CREST-Anteilhaberregister 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 kann die Gesellschaft nur den Anteilsbestand derjenigen Anteilhaber identifizieren, die im CREST-Anteilhaberregister erscheinen.

16. Wesentliche Ereignisse während des Berichtszeitraums

Die folgenden Fonds der Gesellschaft wurden am 2. Juli 2019 an der Londoner Börse (London Stock Exchange) sowie am 10. September 2019 an der Deutschen Börse und der Borsa Italiana gelistet:

- L&G Artificial Intelligence UCITS ETF
- L&G Clean Water UCITS ETF
- L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

Der L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF wurde am 6. August 2019 von der Zentralbank zugelassen, am 30. August 2019 aufgelegt und am 17. September 2019 an der London Stock Exchange gelistet.

Am 4. September 2019 erhielten die im Anteilhaberregister des L&G UK Equity UCITS ETF eingetragenen Personen jeweils eine schriftliche Benachrichtigung mit dem Hinweis, dass die Anlagestrategie des Fonds geändert wurde, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Fonds mit maximal 20 % seines Nettoinventarwerts indirekt in Wertpapiere ein- und desselben Emittenten engagiert sein kann, wobei dieses Limit unter außergewöhnlichen Marktbedingungen auf 35 % je Einzelmittent angehoben werden kann, insbesondere, wenn ein derartiger Emittent eine dominante Marktstellung innehat.

Mit Wirkung vom 1. Oktober 2019 wurde die Gesamtkostenquote (TER) für den L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF, den L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF und den L&G Battery Value-Chain UCITS ETF von 0,75 % auf 0,49 % gesenkt.

Der L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF wurde am 30. August 2019 von der Zentralbank zugelassen und am 26. November 2019 aufgelegt.

Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 sind keine weiteren wesentlichen Ereignisse eingetreten, die die Gesellschaft betreffen.

Anmerkungen zum Halbjahresabschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 (Fortsetzung)

17. Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Berichtszeitraums

Gemäß der Revisionsgesetzgebung der EU müssen Unternehmen von öffentlichem Interesse (Public Interest Entity, „PIE“) nach einer bestimmten Zeitspanne ihre gesetzlich vorgeschriebene Prüfungsgesellschaft wechseln. Da die Gesellschaft in der EU als PIE eingestuft ist und der derzeitige Abschlussprüfer des Unternehmens („KPMG“) die maximal zulässige Zeitspanne tätig gewesen ist, ist das Unternehmen verpflichtet, ab der gesetzlichen Abschlussprüfung im Jahr 2020 eine neue Prüfungsgesellschaft zu bestellen. Der Prüfungsausschuss hat ein Überprüfungsverfahren eingeleitet, und eine neue Prüfungsgesellschaft wird zu gegebener Zeit ernannt und bekannt gegeben.

Am 14. Januar 2019 wurde Feargal Dempsey als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

Die folgenden Fonds der Gesellschaft wurden am 27. Januar 2020 zusätzlich an der Deutschen Börse notiert:

- L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF
- L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

Der folgende Fonds der Gesellschaft wurden am 27. Januar 2020 zusätzlich an der Borsa Italiana notiert:

- L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF

Nach Ablauf des Berichtszeitraums gab es keine weiteren wesentlichen Ereignisse.

18. Eventualverbindlichkeiten und Verpflichtungen

Es bestanden mit Ausnahme der im Abschluss offen gelegten zum 31. Dezember 2019 und zum 30. Juni 2019 keine wesentlichen Eventualverbindlichkeiten oder Verpflichtungen.

19. Vergleichszahlen

Vergleichszahlen wurden, wo erforderlich, an die Darstellung des aktuellen Berichtszeitraums angepasst.

20. Genehmigung des Halbjahresabschlusses

Der Verwaltungsrat hat den ungeprüften Halbjahresabschluss am 27. Februar 2020 genehmigt.

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) | | | |
| 7.300 | Accelink Technologies Co Ltd 'A' | 31.209 | 0,12 |
| 15.900 | Addsino Co Ltd 'A' | 23.328 | 0,09 |
| 11.023 | AECC Aviation Power Co Ltd 'A' | 34.308 | 0,13 |
| 305.415 | Agricultural Bank of China Ltd 'A' | 161.789 | 0,61 |
| 14.170 | Aier Eye Hospital Group Co Ltd 'A' | 80.475 | 0,30 |
| 12.000 | Air China Ltd 'A' | 16.693 | 0,06 |
| 16.300 | Aisino Corp 'A' | 54.218 | 0,20 |
| 69.600 | Aluminum Corp of China Ltd 'A' | 35.371 | 0,13 |
| 5.600 | Angel Yeast Co Ltd 'A' | 24.657 | 0,09 |
| 15.500 | Anhui Anke Biotechnology Group Co Ltd 'A' | 33.578 | 0,13 |
| 22.163 | Anhui Conch Cement Co Ltd 'A' | 174.358 | 0,66 |
| 800 | Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'A' | 15.610 | 0,06 |
| 22.448 | Anhui Jianghuai Automobile Group Corp Ltd 'A' | 16.178 | 0,06 |
| 4.800 | Anhui Kouzi Distillery Co Ltd 'A' | 37.838 | 0,14 |
| 15.512 | Anhui Zhongding Sealing Parts Co Ltd 'A' | 20.153 | 0,08 |
| 26.743 | Anxin Trust Co Ltd 'A' | 17.046 | 0,06 |
| 1.800 | Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd 'A' | 33.464 | 0,13 |
| 1.000 | Autobio Diagnostics Co Ltd 'A' | 13.836 | 0,05 |
| 14.174 | AVIC Aircraft Co Ltd 'A' | 33.330 | 0,13 |
| 45.100 | Avic Capital Co Ltd 'A' | 31.402 | 0,12 |
| 23.775 | AVIC Electromechanical Systems Co Ltd 'A' | 23.687 | 0,09 |
| 6.887 | AVIC Jonhon Optronic Technology Co Ltd 'A' | 38.619 | 0,15 |
| 4.497 | AVICOPTER Plc 'A' | 30.801 | 0,12 |
| 148.944 | Bank of Beijing Co Ltd 'A' | 121.452 | 0,46 |
| 131.700 | Bank of China Ltd 'A' | 69.766 | 0,26 |
| 221.360 | Bank of Communications Co Ltd 'A' | 178.913 | 0,67 |
| 29.820 | Bank of Guiyang Co Ltd 'A' | 40.926 | 0,15 |
| 20.000 | Bank of Hangzhou Co Ltd 'A' | 26.300 | 0,10 |
| 84.700 | Bank of Jiangsu Co Ltd 'A' | 88.035 | 0,33 |
| 83.623 | Bank of Nanjing Co Ltd 'A' | 105.283 | 0,40 |
| 23.200 | Bank of Ningbo Co Ltd 'A' | 93.756 | 0,35 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 81.560 | Bank of Shanghai Co Ltd 'A' | 111.116 | 0,42 |
| 97.929 | Baoshan Iron & Steel Co Ltd 'A' | 80.697 | 0,30 |
| 29.300 | BBMG Corp 'A' | 15.690 | 0,06 |
| 34.890 | Beijing Capital Co Ltd 'A' | 16.479 | 0,06 |
| 26.093 | Beijing Capital Development Co Ltd 'A' | 29.855 | 0,11 |
| 21.646 | Beijing Dabeinong Technology Group Co Ltd 'A' | 15.475 | 0,06 |
| 3.960 | Beijing E-Hualu Information Technology Co Ltd 'A' | 19.011 | 0,07 |
| 10.100 | Beijing Enlight Media Co Ltd 'A' | 17.109 | 0,06 |
| 4.891 | Beijing Gehua CATV Network Co Ltd 'A' | 6.326 | 0,02 |
| 11.200 | Beijing Kunlun Tech Co Ltd 'A' | 26.932 | 0,10 |
| 8.000 | Beijing New Building Materials Plc 'A' | 29.229 | 0,11 |
| 11.220 | Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd 'A' | 42.379 | 0,16 |
| 21.000 | Beijing Originwater Technology Co Ltd 'A' | 22.912 | 0,09 |
| 12.000 | Beijing Sanju Environmental Protection and New Material Co Ltd 'A' | 10.888 | 0,04 |
| 2.500 | Beijing Shiji Information Technology Co Ltd 'A' | 13.997 | 0,05 |
| 4.810 | Beijing Shunxin Agriculture Co Ltd 'A' | 36.377 | 0,14 |
| 11.100 | Beijing Sinnet Technology Co Ltd 'A' | 31.982 | 0,12 |
| 13.500 | Beijing SL Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 25.485 | 0,10 |
| 5.900 | Beijing Thunisoft Corp Ltd 'A' | 21.514 | 0,08 |
| 7.200 | Beijing Tongrentang Co Ltd 'A' | 29.128 | 0,11 |
| 23.559 | Beijing Urban Construction Investment & Development Co Ltd 'A' | 27.395 | 0,10 |
| 26.410 | Beijing Yanjing Brewery Co Ltd 'A' | 24.720 | 0,09 |
| 75.500 | Beiqi Foton Motor Co Ltd 'A' | 22.653 | 0,09 |
| 307.556 | BOE Technology Group Co Ltd 'A' | 200.453 | 0,75 |
| 9.207 | BYD Co Ltd 'A' | 63.008 | 0,24 |
| 11.300 | By-health Co Ltd 'A' | 26.426 | 0,10 |
| 20.600 | Caitong Securities Co Ltd 'A' | 33.536 | 0,13 |
| 19.500 | Centre Testing International Group Co Ltd 'A' | 41.739 | 0,16 |
| 1.725 | Changchun High & New Technology Industry Group Inc 'A' | 110.695 | 0,42 |
| 37.700 | Changjiang Securities Co Ltd 'A' | 38.643 | 0,15 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 19.400 | Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd 'A' | 62.051 | 0,23 |
| 32.736 | Chengdu Xingrong Environment Co Ltd 'A' | 21.759 | 0,08 |
| 28.500 | Chengtun Mining Group Co Ltd 'A' | 21.644 | 0,08 |
| 27.456 | China Aerospace Times Electronics Co Ltd 'A' | 23.571 | 0,09 |
| 43.828 | China Baoan Group Co Ltd 'A' | 38.947 | 0,15 |
| 19.228 | China CITIC Bank Corp Ltd 'A' | 17.031 | 0,06 |
| 15.100 | China Communications Construction Co Ltd 'A' | 19.857 | 0,07 |
| 76.460 | China Construction Bank Corp 'A' | 79.361 | 0,30 |
| 44.428 | China Eastern Airlines Corp Ltd 'A' | 37.057 | 0,14 |
| 167.600 | China Everbright Bank Co Ltd 'A' | 106.107 | 0,40 |
| 6.300 | China Film Co Ltd 'A' | 13.765 | 0,05 |
| 44.000 | China First Heavy Industries 'A' | 18.381 | 0,07 |
| 22.774 | China Fortune Land Development Co Ltd 'A' | 93.833 | 0,35 |
| 33.100 | China Gezhouba Group Co Ltd 'A' | 31.742 | 0,12 |
| 22.300 | China Grand Automotive Services Group Co Ltd 'A' | 10.437 | 0,04 |
| 14.449 | China Greatwall Technology Group Co Ltd 'A' | 32.276 | 0,12 |
| 11.165 | China International Marine Containers Group Co Ltd 'A' | 15.740 | 0,06 |
| 12.058 | China International Travel Service Corp Ltd 'A' | 153.977 | 0,58 |
| 26.990 | China Jushi Co Ltd 'A' | 42.234 | 0,16 |
| 11.906 | China Life Insurance Co Ltd 'A' | 59.601 | 0,22 |
| 8.735 | China Meheco Co Ltd 'A' | 16.365 | 0,06 |
| 140.127 | China Merchants Bank Co Ltd 'A' | 755.983 | 2,84 |
| 16.759 | China Merchants Energy Shipping Co Ltd 'A' | 19.873 | 0,07 |
| 20.343 | China Merchants Securities Co Ltd 'A' | 53.415 | 0,20 |
| 21.512 | China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd 'A' | 61.364 | 0,23 |
| 277.046 | China Minsheng Banking Corp Ltd 'A' | 250.966 | 0,94 |
| 77.800 | China Molybdenum Co Ltd 'A' | 48.697 | 0,18 |
| 21.000 | China National Chemical Engineering Co Ltd 'A' | 19.415 | 0,07 |
| 8.324 | China National Medicines Corp Ltd 'A' | 32.611 | 0,12 |
| 59.500 | China National Nuclear Power Co Ltd 'A' | 42.709 | 0,16 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 4.600 | China National Software & Service Co Ltd 'A' | 47.342 | 0,18 |
| 21.002 | China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd 'A' | 32.683 | 0,12 |
| 34.065 | China Pacific Insurance Group Co Ltd 'A' | 185.052 | 0,70 |
| 101.109 | China Petroleum & Chemical Corp 'A' | 74.173 | 0,28 |
| 49.744 | China Railway Construction Corp Ltd 'A' | 72.412 | 0,27 |
| 81.400 | China Railway Group Ltd 'A' | 69.414 | 0,26 |
| 11.600 | China Railway Hi-tech Industry Co Ltd 'A' | 19.151 | 0,07 |
| 8.200 | China Reform Health Management and Services Group Co Ltd 'A' | 20.154 | 0,08 |
| 7.200 | China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 32.745 | 0,12 |
| 23.614 | China Shenhua Energy Co Ltd 'A' | 61.868 | 0,23 |
| 98.100 | China Shipbuilding Industry Co Ltd 'A' | 73.796 | 0,28 |
| 12.700 | China Shipbuilding Industry Group Power Co Ltd 'A' | 36.464 | 0,14 |
| 7.700 | China South Publishing & Media Group Co Ltd 'A' | 13.199 | 0,05 |
| 43.897 | China Southern Airlines Co Ltd 'A' | 45.247 | 0,17 |
| 10.100 | China Spacesat Co Ltd 'A' | 30.986 | 0,12 |
| 223.532 | China State Construction Engineering Corp Ltd 'A' | 180.347 | 0,68 |
| 7.900 | China TransInfo Technology Co Ltd 'A' | 20.460 | 0,08 |
| 108.259 | China United Network Communications Ltd 'A' | 91.540 | 0,34 |
| 73.661 | China Vanke Co Ltd 'A' | 340.296 | 1,28 |
| 19.200 | China XD Electric Co Ltd 'A' | 10.033 | 0,04 |
| 80.584 | China Yangtze Power Co Ltd 'A' | 212.632 | 0,80 |
| 5.300 | Chinese Universe Publishing and Media Group Co Ltd 'A' | 10.355 | 0,04 |
| 3.400 | Chongqing Brewery Co Ltd 'A' | 25.362 | 0,10 |
| 33.396 | Chongqing Changan Automobile Co Ltd 'A' | 48.087 | 0,18 |
| 5.600 | Chongqing Department Store Co Ltd 'A' | 23.997 | 0,09 |
| 5.700 | Chongqing Fuling Zhacai Group Co Ltd 'A' | 21.873 | 0,08 |
| 5.900 | Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd 'A' | 42.062 | 0,16 |
| 39.270 | CITIC Guoan Information Industry Co Ltd 'A' | 19.957 | 0,08 |
| 92.119 | CITIC Securities Co Ltd 'A' | 334.582 | 1,26 |
| 19.000 | CMST Development Co Ltd 'A' | 14.211 | 0,05 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 13.600 | COFCO Tunhe Sugar Co Ltd 'A' | 16.517 | 0,06 |
| 9.100 | Contemporary Amperex Technology Co Ltd 'A' | 139.001 | 0,52 |
| 60.180 | COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'A' | 22.376 | 0,08 |
| 18.700 | COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'A' | 17.128 | 0,06 |
| 45.156 | COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'A' | 34.163 | 0,13 |
| 97.736 | CRRC Corp Ltd 'A' | 100.181 | 0,38 |
| 68.020 | Dalian Port PDA Co Ltd 'A' | 19.823 | 0,07 |
| 72.834 | Daqin Railway Co Ltd 'A' | 85.844 | 0,32 |
| 9.660 | Dawning Information Industry Co Ltd 'A' | 47.955 | 0,18 |
| 27.168 | DHC Software Co Ltd 'A' | 40.250 | 0,15 |
| 5.427 | Dong-E-E-Jiao Co Ltd 'A' | 27.557 | 0,10 |
| 23.600 | Dongfang Electric Corp Ltd 'A' | 31.136 | 0,12 |
| 14.800 | Dongxing Securities Co Ltd 'A' | 27.918 | 0,11 |
| 10.200 | Eastern Communications Co Ltd 'A' | 30.502 | 0,11 |
| 26.000 | Elion Clean Energy Co Ltd 'A' | 17.020 | 0,06 |
| 6.400 | Eve Energy Co Ltd 'A' | 46.086 | 0,17 |
| 18.800 | Everbright Securities Co Ltd 'A' | 35.356 | 0,13 |
| 18.536 | Fangda Carbon New Material Co Ltd 'A' | 32.358 | 0,12 |
| 10.200 | Fangda Special Steel Technology Co Ltd 'A' | 14.731 | 0,06 |
| 17.401 | FAW CAR Co Ltd 'A' | 24.906 | 0,09 |
| 7.129 | Fiberhome Telecommunication Technologies Co Ltd 'A' | 28.093 | 0,11 |
| 30.000 | Financial Street Holdings Co Ltd 'A' | 34.971 | 0,13 |
| 24.200 | First Capital Securities Co Ltd 'A' | 28.766 | 0,11 |
| 110.280 | Focus Media Information Technology Co Ltd 'A' | 99.107 | 0,37 |
| 7.800 | Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A' | 120.386 | 0,45 |
| 42.865 | Founder Securities Co Ltd 'A' | 53.353 | 0,20 |
| 16.800 | Foxconn Industrial Internet Co Ltd 'A' | 44.064 | 0,17 |
| 12.447 | Fujian Longking Co Ltd 'A' | 17.422 | 0,07 |
| 6.300 | Fujian Star-net Communication Co Ltd 'A' | 32.161 | 0,12 |
| 5.400 | Fujian Sunner Development Co Ltd 'A' | 18.667 | 0,07 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 17.317 | Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'A' | 59.640 | 0,22 |
| 9.150 | Ganfeng Lithium Co Ltd 'A' | 45.752 | 0,17 |
| 300 | G-bits Network Technology Xiamen Co Ltd 'A' | 12.855 | 0,05 |
| 22.600 | GCL System Integration Technology Co Ltd 'A' | 19.175 | 0,07 |
| 158.363 | GD Power Development Co Ltd 'A' | 53.199 | 0,20 |
| 43.420 | GEM Co Ltd 'A' | 30.357 | 0,11 |
| 28.138 | Gemdale Corp 'A' | 58.573 | 0,22 |
| 28.500 | GF Securities Co Ltd 'A' | 62.067 | 0,23 |
| 8.000 | Giant Network Group Co Ltd 'A' | 20.742 | 0,08 |
| 2.200 | Gigadevice Semiconductor Beijing Inc 'A' | 64.711 | 0,24 |
| 9.100 | Global Top E-Commerce Co Ltd 'A' | 10.085 | 0,04 |
| 7.908 | Glodon Co Ltd 'A' | 38.577 | 0,15 |
| 40.870 | GoerTek Inc 'A' | 116.877 | 0,44 |
| 12.200 | Grandjoy Holdings Group Co Ltd 'A' | 12.575 | 0,05 |
| 16.900 | Greatown Holdings Ltd 'A' | 14.193 | 0,05 |
| 51.972 | Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai 'A' | 489.299 | 1,84 |
| 29.500 | Greenland Holdings Corp Ltd 'A' | 29.433 | 0,11 |
| 14.900 | Guangdong Baolihua New Energy Stock Co Ltd 'A' | 25.005 | 0,09 |
| 28.500 | Guangdong Baolihua New Energy Stock Co Ltd 'A' | 23.117 | 0,09 |
| 8.900 | Guangdong Fenghua Advanced Technology Holding Co Ltd 'A' | 19.025 | 0,07 |
| 6.844 | Guangdong Golden Dragon Development Inc 'A' | 14.934 | 0,06 |
| 8.800 | Guangdong Haid Group Co Ltd 'A' | 45.480 | 0,17 |
| 33.600 | Guangdong HEC Technology Holding Co Ltd 'A' | 49.394 | 0,19 |
| 57.980 | Guanghui Energy Co Ltd 'A' | 27.551 | 0,10 |
| 42.434 | Guangshen Railway Co Ltd 'A' | 18.641 | 0,07 |
| 94.704 | Guangxi Wuzhou Zhongheng Group Co Ltd 'A' | 44.322 | 0,17 |
| 17.900 | Guangzhou Baiyun International Airport Co Ltd 'A' | 44.842 | 0,17 |
| 3.839 | Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'A' | 19.626 | 0,07 |
| 19.400 | Guangzhou Haige Communications Group Inc Co 'A' | 30.162 | 0,11 |
| 24.600 | Guosen Securities Co Ltd 'A' | 44.321 | 0,17 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 46.200 | Guotai Junan Securities Co Ltd 'A' | 122.634 | 0,46 |
| 9.900 | Guoxuan High-Tech Co Ltd 'A' | 20.679 | 0,08 |
| 22.777 | Guoyuan Securities Co Ltd 'A' | 30.312 | 0,11 |
| 38.600 | Haier Smart Home Co Ltd 'A' | 108.058 | 0,41 |
| 155.600 | Hainan Airlines Holding Co Ltd 'A' | 38.645 | 0,15 |
| 89.185 | Haitong Securities Co Ltd 'A' | 197.941 | 0,74 |
| 4.100 | Hang Zhou Great Star Industrial Co Ltd 'A' | 6.322 | 0,02 |
| 50.447 | Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd 'A' | 237.109 | 0,89 |
| 7.100 | Hangzhou Robam Appliances Co Ltd 'A' | 34.462 | 0,13 |
| 10.700 | Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd 'A' | 23.763 | 0,09 |
| 5.250 | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'A' | 47.596 | 0,18 |
| 9.305 | Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A' | 53.433 | 0,20 |
| 8.900 | Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co Ltd 'A' | 37.091 | 0,14 |
| 2.700 | Hefei Meiya Optoelectronic Technology Inc 'A' | 15.156 | 0,06 |
| 20.848 | Henan Pinggao Electric Co Ltd 'A' | 19.334 | 0,07 |
| 10.317 | Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd 'A' | 42.997 | 0,16 |
| 19.040 | Hengli Petrochemical Co Ltd 'A' | 43.953 | 0,17 |
| 13.380 | Hengtong Optic-electric Co Ltd 'A' | 31.233 | 0,12 |
| 18.200 | Hengyi Petrochemical Co Ltd 'A' | 36.370 | 0,14 |
| 35.172 | Hesteel Co Ltd 'A' | 13.027 | 0,05 |
| 16.200 | HLA Corp Ltd 'A' | 17.861 | 0,07 |
| 21.900 | Holitech Technology Co Ltd 'A' | 17.449 | 0,07 |
| 5.400 | Hongfa Technology Co Ltd 'A' | 26.706 | 0,10 |
| 29.300 | Huaan Securities Co Ltd 'A' | 30.706 | 0,12 |
| 9.258 | Huadong Medicine Co Ltd 'A' | 32.403 | 0,12 |
| 16.420 | Huafa Industrial Co Ltd Zhuhai 'A' | 18.457 | 0,07 |
| 16.650 | Huafon Microfibre Shanghai Technology Co Ltd 'A' | 21.130 | 0,08 |
| 11.156 | Huagong Tech Co Ltd 'A' | 32.496 | 0,12 |
| 7.896 | Hualan Biological Engineering Inc 'A' | 39.844 | 0,15 |
| 19.477 | Huaneng Power International Inc 'A' | 15.602 | 0,06 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 48.667 | Huatai Securities Co Ltd 'A' | 141.899 | 0,53 |
| 18.600 | Huaxi Securities Co Ltd 'A' | 29.399 | 0,11 |
| 47.992 | Huaxia Bank Co Ltd 'A' | 52.844 | 0,20 |
| 29.800 | Huayi Brothers Media Corp 'A' | 19.808 | 0,07 |
| 16.881 | Huayu Automotive Systems Co Ltd 'A' | 62.985 | 0,24 |
| 20.600 | Hubei Biocause Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 20.820 | 0,08 |
| 9.800 | Hubei Kaile Science & Technology Co Ltd 'A' | 19.091 | 0,07 |
| 20.670 | Humanwell Healthcare Group Co Ltd 'A' | 40.089 | 0,15 |
| 42.420 | Hunan Valin Steel Co Ltd 'A' | 29.109 | 0,11 |
| 7.634 | Hundsun Technologies Inc 'A' | 85.187 | 0,32 |
| 18.200 | Hytera Communications Corp Ltd 'A' | 21.974 | 0,08 |
| 16.211 | Iflytek Co Ltd 'A' | 80.244 | 0,30 |
| 202.268 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A' | 170.741 | 0,64 |
| 164.035 | Industrial Bank Co Ltd 'A' | 466.267 | 1,75 |
| 43.564 | Industrial Securities Co Ltd 'A' | 44.279 | 0,17 |
| 271.333 | Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd 'A' | 51.417 | 0,19 |
| 15.216 | Inner Mongolia First Machinery Group Co Ltd 'A' | 23.220 | 0,09 |
| 61.106 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A' | 271.417 | 1,02 |
| 20.460 | Inspur Electronic Information Industry Co Ltd 'A' | 88.411 | 0,33 |
| 1.800 | Jaftron Biomedical Co Ltd 'A' | 18.564 | 0,07 |
| 19.000 | JCET Group Co Ltd 'A' | 59.954 | 0,23 |
| 16.200 | Jiangsu Broadcasting Cable Information Network Corp Ltd 'A' | 9.256 | 0,03 |
| 31.800 | Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd 'A' | 41.589 | 0,16 |
| 5.000 | Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd 'A' | 35.711 | 0,13 |
| 25.663 | Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd 'A' | 322.439 | 1,21 |
| 29.040 | Jiangsu Jiangyin Rural Commercial Bank Co Ltd 'A' | 19.427 | 0,07 |
| 5.900 | Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd 'A' | 27.714 | 0,10 |
| 6.500 | Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd 'A' | 103.112 | 0,39 |
| 2.700 | Jiangsu Yangnong Chemical Co Ltd 'A' | 26.602 | 0,10 |
| 6.000 | Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd 'A' | 17.503 | 0,07 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 23.600 | Jiangsu Zhongnan Construction Group Co Ltd 'A' | 35.744 | 0,13 |
| 19.750 | Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd 'A' | 23.533 | 0,09 |
| 14.500 | Jiangxi Copper Co Ltd 'A' | 35.242 | 0,13 |
| 17.100 | Jiangxi Zhengbang Technology Co Ltd 'A' | 39.769 | 0,15 |
| 16.600 | Jihua Group Corp Ltd 'A' | 7.769 | 0,03 |
| 4.857 | Jilin Aodong Pharmaceutical Group Co Ltd 'A' | 11.526 | 0,04 |
| 40.024 | Jilin Yatai Group Co Ltd 'A' | 18.329 | 0,07 |
| 20.194 | Jinduicheng Molybdenum Co Ltd 'A' | 23.221 | 0,09 |
| 28.400 | Jinke Properties Group Co Ltd 'A' | 31.312 | 0,12 |
| 21.229 | Jinyu Bio-Technology Co Ltd 'A' | 57.052 | 0,21 |
| 25.700 | Joicare Pharmaceutical Group Industry Co Ltd 'A' | 38.186 | 0,14 |
| 7.200 | Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd 'A' | 14.626 | 0,06 |
| 6.000 | Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding Co Ltd 'A' | 33.895 | 0,13 |
| 3.900 | Juwei Food Co Ltd 'A' | 26.007 | 0,10 |
| 26.900 | Kingenta Ecological Engineering Group Co Ltd 'A' | 10.272 | 0,04 |
| 27.400 | Kingfa Sci & Tech Co Ltd 'A' | 28.636 | 0,11 |
| 5.387 | Kweichow Moutai Co Ltd 'A' | 914.882 | 3,44 |
| 91.489 | Leo Group Co Ltd 'A' | 39.008 | 0,15 |
| 13.200 | Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd 'A' | 62.686 | 0,24 |
| 20.400 | Leyard Optoelectronic Co Ltd 'A' | 22.463 | 0,08 |
| 12.253 | Liaoning Cheng Da Co Ltd 'A' | 26.790 | 0,10 |
| 26.400 | Lingyi iTech Guangdong Co 'A' | 41.121 | 0,15 |
| 5.070 | Livzon Pharmaceutical Group Inc 'A' | 24.529 | 0,09 |
| 33.490 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 119.378 | 0,45 |
| 13.700 | Luxi Chemical Group Co Ltd 'A' | 20.671 | 0,08 |
| 45.542 | Luxshare Precision Industry Co Ltd 'A' | 238.637 | 0,90 |
| 8.200 | Luzhou Laojiao Co Ltd 'A' | 102.039 | 0,38 |
| 39.400 | Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'A' | 17.365 | 0,07 |
| 5.600 | Mango Excellent Media Co Ltd 'A' | 28.106 | 0,11 |
| 32.972 | Meihua Holdings Group Co Ltd 'A' | 21.064 | 0,08 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 27.960 | Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd 'A' | 59.768 | 0,22 |
| 73.900 | Metallurgical Corp of China Ltd 'A' | 29.705 | 0,11 |
| 51.542 | Midea Group Co Ltd 'A' | 431.013 | 1,62 |
| 6.120 | Muyuan Foodstuff Co Ltd 'A' | 78.010 | 0,29 |
| 12.200 | NanJi E-Commerce Co Ltd 'A' | 19.108 | 0,07 |
| 22.400 | Nanjing Securities Co Ltd 'A' | 41.515 | 0,16 |
| 21.588 | NARI Technology Co Ltd 'A' | 65.640 | 0,25 |
| 2.500 | NAURA Technology Group Co Ltd 'A' | 31.583 | 0,12 |
| 14.925 | NavInfo Co Ltd 'A' | 34.496 | 0,13 |
| 12.700 | Neusoft Corp 'A' | 20.693 | 0,08 |
| 10.077 | New China Life Insurance Co Ltd 'A' | 71.103 | 0,27 |
| 21.100 | New Hope Liuhe Co Ltd 'A' | 60.431 | 0,23 |
| 12.000 | Newland Digital Technology Co Ltd 'A' | 27.357 | 0,10 |
| 8.640 | Ningbo Joyson Electronic Corp 'A' | 22.202 | 0,08 |
| 23.100 | Ningbo Shanshan Co Ltd 'A' | 44.802 | 0,17 |
| 21.788 | North Navigation Control Technology Co Ltd 'A' | 26.024 | 0,10 |
| 21.082 | Northeast Securities Co Ltd 'A' | 28.147 | 0,11 |
| 20.491 | Offshore Oil Engineering Co Ltd 'A' | 21.710 | 0,08 |
| 25.216 | OFILM Group Co Ltd 'A' | 56.472 | 0,21 |
| 23.900 | ORG Technology Co Ltd 'A' | 15.131 | 0,06 |
| 31.100 | Orient Securities Co Ltd/China 'A' | 48.040 | 0,18 |
| 4.800 | Oriental Energy Co Ltd 'A' | 5.347 | 0,02 |
| 6.293 | Oriental Pearl Group Co Ltd 'A' | 8.456 | 0,03 |
| 2.000 | Ovctek China Inc 'A' | 13.589 | 0,05 |
| 73.737 | Pacific Securities Co Ltd/The/China 'A' | 40.120 | 0,15 |
| 18.520 | PCI-Suntek Technology Co Ltd 'A' | 24.939 | 0,09 |
| 4.700 | People.cn Co Ltd 'A' | 13.353 | 0,05 |
| 66.883 | PetroChina Co Ltd 'A' | 55.978 | 0,21 |
| 83.000 | Ping An Bank Co Ltd 'A' | 196.010 | 0,74 |
| 115.698 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A' | 1.419.457 | 5,34 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 87.859 | Poly Developments and Holdings Group Co Ltd 'A' | 204.079 | 0,77 |
| 47.084 | Power Construction Corp of China Ltd 'A' | 29.336 | 0,11 |
| 8.700 | Qingdao TGOOD Electric Co Ltd 'A' | 21.457 | 0,08 |
| 21.700 | RiseSun Real Estate Development Co Ltd 'A' | 30.623 | 0,12 |
| 13.000 | Rongsheng Petro Chemical Co Ltd 'A' | 23.123 | 0,09 |
| 33.147 | SAIC Motor Corp Ltd 'A' | 113.492 | 0,43 |
| 30.981 | Sanan Optoelectronics Co Ltd 'A' | 81.659 | 0,31 |
| 28.450 | Sansteel Minguang Co Ltd Fujian 'A' | 38.229 | 0,14 |
| 60.282 | Sany Heavy Industry Co Ltd 'A' | 147.552 | 0,56 |
| 16.800 | SDIC Capital Co Ltd 'A' | 36.515 | 0,14 |
| 52.547 | SDIC Power Holdings Co Ltd 'A' | 69.251 | 0,26 |
| 39.950 | Sealand Securities Co Ltd 'A' | 30.626 | 0,12 |
| 10.100 | Seazen Holdings Co Ltd 'A' | 56.142 | 0,21 |
| 5.500 | SF Holding Co Ltd 'A' | 29.364 | 0,11 |
| 29.100 | Shaanxi Coal Industry Co Ltd 'A' | 37.557 | 0,14 |
| 11.810 | Shandong Gold Mining Co Ltd 'A' | 55.305 | 0,21 |
| 6.800 | Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co Ltd 'A' | 18.450 | 0,07 |
| 13.251 | Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd 'A' | 37.799 | 0,14 |
| 105.088 | Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd 'A' | 33.794 | 0,13 |
| 9.700 | Shandong Sinocera Functional Material Co Ltd 'A' | 31.819 | 0,12 |
| 50.000 | Shandong Xinchao Energy Corp Ltd 'A' | 15.074 | 0,06 |
| 53.300 | Shanghai 2345 Network Holding Group Co Ltd 'A' | 24.715 | 0,09 |
| 4.349 | Shanghai AJ Group Co Ltd 'A' | 5.994 | 0,02 |
| 9.129 | Shanghai Bailian Group Co Ltd 'A' | 11.769 | 0,04 |
| 7.600 | Shanghai Baosight Software Co Ltd 'A' | 35.896 | 0,14 |
| 30.274 | Shanghai Construction Group Co Ltd 'A' | 15.385 | 0,06 |
| 20.504 | Shanghai Dazhong Public Utilities Group Co Ltd 'A' | 14.453 | 0,05 |
| 39.100 | Shanghai Electric Group Co Ltd 'A' | 27.954 | 0,11 |
| 8.800 | Shanghai Electric Power Co Ltd 'A' | 10.170 | 0,04 |
| 16.700 | Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'A' | 63.772 | 0,24 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 11.378 | Shanghai International Airport Co Ltd 'A' | 128.632 | 0,48 |
| 20.484 | Shanghai International Port Group Co Ltd 'A' | 16.968 | 0,06 |
| 3.584 | Shanghai Jahwa United Co Ltd 'A' | 15.919 | 0,06 |
| 4.203 | Shanghai M&G Stationery Inc 'A' | 29.409 | 0,11 |
| 13.030 | Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'A' | 34.363 | 0,13 |
| 158.233 | Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd 'A' | 280.996 | 1,06 |
| 15.446 | Shanghai SMI Holding Co Ltd 'A' | 12.684 | 0,05 |
| 26.080 | Shanghai Tunnel Engineering Co Ltd 'A' | 22.614 | 0,09 |
| 9.500 | Shanghai Zhangjiang High-Tech Park Development Co Ltd 'A' | 20.880 | 0,08 |
| 41.011 | Shanghai Zhenhua Heavy Industries Co Ltd 'A' | 21.372 | 0,08 |
| 12.400 | Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd 'A' | 12.924 | 0,05 |
| 26.700 | Shanxi Securities Co Ltd 'A' | 31.776 | 0,12 |
| 3.300 | Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd 'A' | 42.495 | 0,16 |
| 19.824 | Shanxi Xishan Coal & Electricity Power Co Ltd 'A' | 17.446 | 0,07 |
| 105.800 | Shanying International Holding Co Ltd 'A' | 57.261 | 0,22 |
| 15.300 | Shenghe Resources Holding Co Ltd 'A' | 19.922 | 0,08 |
| 10.004 | Shengyi Technology Co Ltd 'A' | 30.045 | 0,11 |
| 1.560 | Shennan Circuits Co Ltd 'A' | 31.824 | 0,12 |
| 88.100 | Shenwan Hongyuan Group Co Ltd 'A' | 64.756 | 0,24 |
| 17.000 | Shenzhen Energy Group Co Ltd 'A' | 15.156 | 0,06 |
| 9.700 | Shenzhen Jinjia Group Co Ltd 'A' | 15.889 | 0,06 |
| 6.400 | Shenzhen Kingdom Sci-Tech Co Ltd 'A' | 18.909 | 0,07 |
| 1.600 | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd 'A' | 41.782 | 0,16 |
| 60.026 | Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd 'A' | 67.129 | 0,25 |
| 7.800 | Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd 'A' | 25.867 | 0,10 |
| 10.300 | Shenzhen Sunway Communication Co Ltd 'A' | 67.102 | 0,25 |
| 34.143 | Shenzhen Zhongjin Lingnan Nonfemet Co Ltd 'A' | 21.077 | 0,08 |
| 9.900 | Siasun Robot & Automation Co Ltd 'A' | 19.897 | 0,07 |
| 62.350 | Sichuan Changhong Electric Co Ltd 'A' | 26.047 | 0,10 |
| 8.124 | Sichuan Chuantou Energy Co Ltd 'A' | 11.488 | 0,04 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 78.500 | Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd 'A' | 16.679 | 0,06 |
| 12.804 | Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 43.178 | 0,16 |
| 15.900 | Sichuan Languang Development Co Ltd 'A' | 16.823 | 0,06 |
| 20.532 | Sichuan Road & Bridge Co Ltd 'A' | 9.904 | 0,04 |
| 3.500 | Sichuan Swellfun Co Ltd 'A' | 26.002 | 0,10 |
| 19.630 | Sinochem International Corp 'A' | 14.936 | 0,06 |
| 34.285 | Sinolink Securities Co Ltd 'A' | 45.774 | 0,17 |
| 12.400 | Sinoma International Engineering Co 'A' | 12.408 | 0,05 |
| 9.200 | Songcheng Performance Development Co Ltd 'A' | 40.824 | 0,15 |
| 17.323 | SooChow Securities Co Ltd 'A' | 24.844 | 0,09 |
| 34.900 | Southwest Securities Co Ltd 'A' | 26.003 | 0,10 |
| 3.000 | Spring Airlines Co Ltd 'A' | 18.903 | 0,07 |
| 16.400 | Sungrow Power Supply Co Ltd 'A' | 24.792 | 0,09 |
| 7.900 | Suning Universal Co Ltd 'A' | 4.332 | 0,02 |
| 35.215 | Suning.com Co Ltd 'A' | 51.111 | 0,19 |
| 13.900 | Sunwoda Electronic Co Ltd 'A' | 38.952 | 0,15 |
| 8.600 | Suofeiya Home Collection Co Ltd 'A' | 25.865 | 0,10 |
| 15.800 | Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd 'A' | 52.510 | 0,20 |
| 16.588 | Suzhou Gold Mantis Construction Decoration Co Ltd 'A' | 21.004 | 0,08 |
| 10.500 | Tangshan Jidong Cement Co Ltd 'A' | 25.641 | 0,10 |
| 50.500 | TangShan Port Group Co Ltd 'A' | 18.849 | 0,07 |
| 15.925 | Tasly Pharmaceutical Group Co Ltd 'A' | 35.253 | 0,13 |
| 48.638 | TBEA Co Ltd 'A' | 46.433 | 0,17 |
| 128.037 | TCL Corp 'A' | 82.163 | 0,31 |
| 9.500 | Tech-Bank Food Co Ltd 'A' | 17.116 | 0,06 |
| 21.177 | Tianjin Port Co Ltd 'A' | 19.092 | 0,07 |
| 29.600 | Tianjin Zhonghuan Semiconductor Co Ltd 'A' | 50.185 | 0,19 |
| 10.800 | Tianma Microelectronics Co Ltd 'A' | 25.257 | 0,10 |
| 8.200 | Tianqi Lithium Corp 'A' | 35.528 | 0,13 |
| 51.989 | Tianshui Huatian Technology Co Ltd 'A' | 55.753 | 0,21 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 14.600 | Tonghua Dongbao Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 26.514 | 0,10 |
| 22.580 | Tongkun Group Co Ltd 'A' | 48.591 | 0,18 |
| 115.200 | Tongling Nonferrous Metals Group Co Ltd 'A' | 38.534 | 0,15 |
| 26.000 | Tongwei Co Ltd 'A' | 49.009 | 0,18 |
| 3.200 | Topchoice Medical Corp 'A' | 47.101 | 0,18 |
| 24.450 | Tsinghua Tongfang Co Ltd 'A' | 30.783 | 0,12 |
| 2.900 | Tsingtao Brewery Co Ltd 'A' | 21.233 | 0,08 |
| 39.700 | Tunghsu Optoelectronic Technology Co Ltd 'A' | 19.150 | 0,07 |
| 8.501 | Tus Environmental Science And Technology Development Co Ltd 'A' | 11.203 | 0,04 |
| 5.000 | Unigroup Guoxin Microelectronics Co Ltd 'A' | 36.493 | 0,14 |
| 4.704 | Unisplendour Corp Ltd 'A' | 21.340 | 0,08 |
| 8.900 | Venustech Group Inc 'A' | 43.186 | 0,16 |
| 4.800 | Visual China Group Co Ltd 'A' | 11.880 | 0,04 |
| 12.600 | Walvax Biotechnology Co Ltd 'A' | 58.679 | 0,22 |
| 12.100 | Wanda Film Holding Co Ltd 'A' | 31.528 | 0,12 |
| 7.280 | Wangfujing Group Co Ltd 'A' | 14.621 | 0,06 |
| 17.200 | Wanhua Chemical Group Co Ltd 'A' | 138.697 | 0,52 |
| 29.114 | Wanxiang Qianchao Co Ltd 'A' | 22.444 | 0,08 |
| 50.600 | Weichai Power Co Ltd 'A' | 115.354 | 0,43 |
| 46.600 | Wens Foodstuffs Group Co Ltd 'A' | 224.780 | 0,85 |
| 29.032 | Western Mining Co Ltd 'A' | 27.591 | 0,10 |
| 26.334 | Western Securities Co Ltd 'A' | 37.049 | 0,14 |
| 6.240 | Westone Information Industry Inc 'A' | 23.103 | 0,09 |
| 12.300 | Winning Health Technology Group Co Ltd 'A' | 26.451 | 0,10 |
| 11.700 | Wonders Information Co Ltd 'A' | 25.917 | 0,10 |
| 30.875 | Wuchan Zhongda Group Co Ltd 'A' | 23.270 | 0,09 |
| 12.600 | Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd 'A' | 48.712 | 0,18 |
| 34.300 | Wuhu Token Science Co Ltd 'A' | 50.571 | 0,19 |
| 19.225 | Wuliangye Yibin Co Ltd 'A' | 367.100 | 1,38 |
| 11.700 | WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd 'A' | 37.305 | 0,14 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 5.800 | WuXi AppTec Co Ltd 'A' | 76.704 | 0,29 |
| 5.500 | Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd 'A' | 35.484 | 0,13 |
| 22.900 | Wuxi Rural Commercial Bank Co Ltd 'A' | 18.246 | 0,07 |
| 44.520 | XCMG Construction Machinery Co Ltd 'A' | 34.960 | 0,13 |
| 24.057 | Xiamen C & D Inc 'A' | 31.048 | 0,12 |
| 31.700 | Xiamen ITG Group Corp Ltd 'A' | 33.403 | 0,13 |
| 5.600 | Xiamen Meiya Pico Information Co Ltd 'A' | 13.747 | 0,05 |
| 67.328 | Xinhu Zhongbao Co Ltd 'A' | 36.536 | 0,14 |
| 23.918 | Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'A' | 41.032 | 0,15 |
| 17.700 | Xinjiang Zhongtai Chemical Co Ltd 'A' | 17.253 | 0,06 |
| 36.769 | Xinxing Ductile Iron Pipes Co Ltd 'A' | 22.012 | 0,08 |
| 9.300 | Xinyangfeng Agricultural Technology Co Ltd 'A' | 10.547 | 0,04 |
| 38.400 | Xinyu Iron & Steel Co Ltd 'A' | 28.280 | 0,11 |
| 7.299 | Xuji Electric Co Ltd 'A' | 11.285 | 0,04 |
| 28.995 | Yang Quan Coal Industry Group Co Ltd 'A' | 23.019 | 0,09 |
| 21.800 | Yango Group Co Ltd 'A' | 26.602 | 0,10 |
| 13.700 | Yango Group Co Ltd 'A' | 60.262 | 0,23 |
| 10.660 | Yantai Jereh Oilfield Services Group Co Ltd 'A' | 56.562 | 0,21 |
| 16.700 | Yifan Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 38.959 | 0,15 |
| 16.660 | Yintai Gold Co Ltd 'A' | 32.551 | 0,12 |
| 47.894 | Yonghui Superstores Co Ltd 'A' | 51.842 | 0,20 |
| 15.400 | Yonyou Network Technology Co Ltd 'A' | 62.787 | 0,24 |
| 43.120 | Youngor Group Co Ltd 'A' | 43.146 | 0,16 |
| 8.800 | Youzu Interactive Co Ltd 'A' | 29.398 | 0,11 |
| 18.490 | Yuan Longping High-tech Agriculture Co Ltd 'A' | 39.047 | 0,15 |
| 5.700 | Yunda Holding Co Ltd 'A' | 27.249 | 0,10 |
| 7.126 | Yunnan Baiyao Group Co Ltd 'A' | 91.488 | 0,34 |
| 45.000 | Yunnan Chihong Zinc&Germanium Co Ltd 'A' | 28.296 | 0,11 |
| 11.136 | Yunnan Copper Co Ltd 'A' | 21.838 | 0,08 |
| 28.296 | Yunnan Tin Co Ltd 'A' | 42.409 | 0,16 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|-------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung) | | | |
| 2.400 | Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 37.855 | 0,14 |
| 39.000 | Zhejiang China Commodities City Group Co Ltd 'A' | 21.668 | 0,08 |
| 9.200 | Zhejiang Chint Electrics Co Ltd 'A' | 35.396 | 0,13 |
| 21.200 | Zhejiang Conba Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 18.717 | 0,07 |
| 13.800 | Zhejiang Crystal-Optech Co Ltd 'A' | 32.015 | 0,12 |
| 20.185 | Zhejiang Dahua Technology Co Ltd 'A' | 57.607 | 0,22 |
| 1.600 | Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd 'A' | 16.423 | 0,06 |
| 15.200 | Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 37.663 | 0,14 |
| 6.552 | Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd 'A' | 37.050 | 0,14 |
| 13.800 | Zhejiang Jiahua Energy Chemical Industry Co Ltd 'A' | 22.288 | 0,08 |
| 14.156 | Zhejiang Juhua Co Ltd 'A' | 14.795 | 0,06 |
| 27.700 | Zhejiang Longsheng Group Co Ltd 'A' | 57.542 | 0,22 |
| 11.468 | Zhejiang Medicine Co Ltd 'A' | 21.979 | 0,08 |
| 17.815 | Zhejiang NHU Co Ltd 'A' | 59.488 | 0,22 |
| 8.669 | Zhejiang Orient Financial Holdings Group Co Ltd 'A' | 10.865 | 0,04 |
| 20.464 | Zhejiang Runtu Co Ltd 'A' | 32.903 | 0,12 |
| 19.240 | Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd 'A' | 47.867 | 0,18 |
| 2.400 | Zhejiang Supor Co Ltd 'A' | 26.454 | 0,10 |
| 17.840 | Zhejiang Wanfeng Auto Wheel Co Ltd 'A' | 17.928 | 0,07 |
| 13.200 | Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd 'A' | 24.957 | 0,09 |
| 2.600 | Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd 'A' | 16.479 | 0,06 |
| 16.876 | Zhengzhou Yutong Bus Co Ltd 'A' | 34.524 | 0,13 |
| 9.600 | Zheshang Securities Co Ltd 'A' | 15.339 | 0,06 |
| 21.971 | Zhongjin Gold Corp Ltd 'A' | 26.747 | 0,10 |
| 151.636 | Zijin Mining Group Co Ltd 'A' | 99.919 | 0,38 |
| 42.986 | Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'A' | 41.223 | 0,16 |
| 29.100 | ZTE Corp 'A' | 147.845 | 0,56 |
| Stammaktien insgesamt | | 26.357.517 | 99,14 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|-------------------|------------------------------|
| Bezugsrechte (30. Juni 2019: – %) | | | |
| 2.460 | Tianqi Lithium Corp-A-Rights 20/01/2020 'A' (Right) | 7.568 | 0,03 |
| Bezugsrechte insgesamt | | 7.568 | 0,03 |
| Gesamtanlagen | | | |
| | Stammaktien | 26.357.517 | 99,14 |
| | Bezugsrechte | 7.568 | 0,03 |
| | Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 220.501 | 0,83 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 26.585.586 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamtvermögens |
| | Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 99,10 |
| | Sonstige Vermögenswerte | | 0,90 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Kupon- satz | Fälligkeits- termin | Wert € | % des Nettover- mögens |
|--|---|----------------|------------------------|---------------------------------------|--|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 91,07 %) | | | | | |
| 22.709.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 22.01.2020 | 22.709.130 | 94,05 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | | | 22.709.130 | 94,05 |
| Nominal- betrag | Beschreibung | | | Nicht realisierter Verlust € | % des Nettover- mögens |
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,68 %) | | | | | |
| 24.371.602 | LevDAX® x2 Index ¹ | | 20.01.2020 | (254.622) | (1,05) |
| Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten | | | | (254.622) | (1,05) |
| Nominal- betrag | Beschreibung | | | Wert € | % des Nettover- mögens |
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: – %) | | | | | |
| 17.065 | BlackRock Institutional Euro Cash Plus Fund | | | 1.702.091 | 7,05 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | | | 1.702.091 | 7,05 |
| Gesamtanlagen | | | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | | | 22.709.130 | 94,05 |
| Geldmarktinstrumente | | | | 1.702.091 | 7,05 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten | | | | (254.622) | (1,05) |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | (11.565) | (0,05) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | | | 24.145.034 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | % des Gesamt- vermö- gens |
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | | | 6,97 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | | | 93,03 |
| | | | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW- Vorschriften vorgeschrieben. | | | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Kupon-satz | Fälligkeits-termin | Wert € | % des Nettover-mögens |
|--|----------------------------------|------------|--------------------|-------------------|--------------------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 96,59 %) | | | | | |
| 63.314.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 22.01.2020 | 63.314.000 | 93,28 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | | | 63.314.000 | 93,28 |

| Nominal-betrag | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn € | % des Nettover-mögens | | |
|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------|-------------|------|
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: (0,79 %)) | | | | | |
| 67.123.346 | ShortDAX® x2 Index ¹ | | 20.01.2020 | 665.317 | 0,98 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | | 665.317 | 0,98 | |

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover-mögens |
|--|---|------------------|--------------------------|
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: – %) | | | |
| 46.124 | BlackRock Institutional Euro Cash Plus Fund | 4.600.669 | 6,78 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | 4.600.669 | 6,78 |

| Gesamtanlagen | | | |
|--|---|-------------------|---------------|
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 63.314.000 | 93,28 |
| | Geldmarktinstrumente | 4.600.669 | 6,78 |
| | Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | 665.317 | 0,98 |
| | Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | (707.759) | (1,04) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 67.872.227 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamt- vermö- gens |
|---|--|--|------------------------------------|
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | 6,71 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | 92,32 |
| Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | 0,97 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | 0,00 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Kupon- satz | Fälligkeits- termin | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|----------------|------------------------|---|--|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 93,42 %) | | | | | |
| 1.051.000 | Barclays Bank Plc | 1,81 % | 23.01.2020 | 1.051.000 | 0,17 |
| 562.716.449 | Barclays Bank Plc | 1,81 % | 23.01.2020 | 562.716.449 | 90,65 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | | | 563.767.449 | 90,82 |
| Nominal- betrag | Beschreibung | | | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,62 %) | | | | | |
| 615.790.230 | Dow Jones-UBS Commodity Index Total Return ¹ | | 20.01.2020 | 5.024.747 | 0,81 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | | | 5.024.747 | 0,81 |
| Nominal | Beschreibung | | | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 7,44 %) | | | | | |
| 60.162.161 | BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund | | | 60.162.161 | 9,69 |
| Geldmarktinstrumente insgesamt | | | | 60.162.161 | 9,69 |
| Gesamtanlagen | | | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | | | 563.767.449 | 90,82 |
| Geldmarktinstrumente | | | | 60.162.161 | 9,69 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | | | 5.024.747 | 0,81 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | (8.210.620) | (1,32) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | | | 620.743.737 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | % des Gesamt- vermö- gens |
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | | | 9,56 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | | | 89,61 |
| Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | | | 0,80 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 0,03 |
| | | | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Kupon- satz | Fälligkeits- termin | Wert £ | % des Nettover- mögens |
|---|---|----------------|------------------------|---------------------------------------|--|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 92,88 %) | | | | | |
| 9.959.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.01.2020 | 9.959.000 | 97,36 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | | | 9.959.000 | 97,36 |
| Nominal- betrag | Beschreibung | | | Nicht realisierter Verlust £ | % des Nettover- mögens |
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,17 %) | | | | | |
| 10.308.111 | FTSE 100® Leveraged Index ¹ | 20.01.2020 | | (96.204) | (0,94) |
| Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten | | | | (96.204) | (0,94) |
| Nominal | Beschreibung | | | Wert £ | % des Nettover- mögens |
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 7,04 %) | | | | | |
| 543.381 | BlackRock Institutional Sterling Cash Plus Fund | | | 543.381 | 5,31 |
| Geldmarktinstrumente insgesamt | | | | 543.381 | 5,31 |
| Gesamtanlagen | | | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | | | 9.959.000 | 97,36 |
| Geldmarktinstrumente | | | | 543.381 | 5,31 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten | | | | (96.204) | (0,94) |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | (177.364) | (1,73) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | | | 10.228.813 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | % des Gesamt- vermö- gens |
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | | | 5,17 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | | | 94,83 |
| | | | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Kupon-satz | Fälligkeits-termin | Wert £ | % des Nettover-mögens |
|--|----------------------------------|------------|--------------------|-------------------|--------------------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 92,85 %) | | | | | |
| 330.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.01.2020 | 330.000 | 2,53 |
| 11.498.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.01.2020 | 11.498.751 | 88,04 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | | | 11.828.751 | 90,57 |

| Nominal-betrag | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn £ | % des Nettover-mögens | |
|--|---|--------------------------------|--------------------------|-------------|
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: (0,18 %)) | | | | |
| 12.925.363 | FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index ¹ | 20.01.2020 | 118.088 | 0,90 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | | 118.088 | 0,90 |

| Nominal | Beschreibung | Wert £ | % des Nettover-mögens |
|---|---|----------------|--------------------------|
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 6,82 %) | | | |
| 890.727 | BlackRock Institutional Sterling Cash Plus Fund | 890.727 | 6,82 |
| Geldmarktinstrumente insgesamt | | 890.727 | 6,82 |

| Gesamtanlagen | | | |
|--|--|-------------------|---------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | 11.828.751 | 90,57 |
| Geldmarktinstrumente | | 890.727 | 6,82 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | 118.088 | 0,90 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | 222.468 | 1,71 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 13.060.034 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamt- vermö- gens |
|---|--|--|------------------------------------|
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | 6,82 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | 90,52 |
| Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | 0,90 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | 1,76 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Kupon- satz | Fälligkeits- termin | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|----------------|------------------------|--|--|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 92,72 %) | | | | | |
| 57.709.750 | Merrill Lynch International | 1,78 % | 23.01.2020 | 57.709.750 | 93,03 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | | | 57.709.750 | 93,03 |
| Nominal- betrag | Beschreibung | | | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettover- mögens |
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,25 %) | | | | | |
| 62.129.340 | Russell 2000® Index ¹ | 20.01.2020 | | (93.802) | (0,15) |
| Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten | | | | (93.802) | (0,15) |
| Nominal | Beschreibung | | | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 4,33 %) | | | | | |
| 4.163.344 | BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund | | | 4.163.344 | 6,71 |
| Geldmarktinstrumente insgesamt | | | | 4.163.344 | 6,71 |
| Gesamtanlagen | | | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | | | 57.709.750 | 93,03 |
| Geldmarktinstrumente | | | | 4.163.344 | 6,71 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten | | | | (93.802) | (0,15) |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | 253.137 | 0,41 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | | | 62.032.429 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | % des Gesamt- vermö- gens |
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | | | 6,70 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | | | 92,84 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 0,46 |
| | | | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW- Vorschriften vorgeschrieben. | | | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Merrill Lynch International.

L&G Gold Mining UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Kupon-satz | Fälligkeits-termin | Wert US\$ | % des Nettover-mögens |
|---|--|------------|--------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 92,78 %) | | | | | |
| 215.171.799 | Merrill Lynch International | 1,78 % | 23.01.2020 | 215.171.799 | 86,79 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | | | 215.171.799 | 86,79 |
| Nominal-betrag | Beschreibung | | | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover-mögens |
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 3,24 %) | | | | | |
| 230.188.118 | DAXglobal® Gold Miners (TR) USD Index ¹ | | 20.01.2020 | 17.871.410 | 7,21 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | | | 17.871.410 | 7,21 |
| Nominal | Beschreibung | | | Wert US\$ | % des Nettover-mögens |
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 6,36 %) | | | | | |
| 32.762.553 | BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund | | | 32.762.553 | 13,21 |
| Geldmarktinstrumente insgesamt | | | | 32.762.553 | 13,21 |
| Gesamtanlagen | | | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | | | 215.171.799 | 86,79 |
| Geldmarktinstrumente | | | | 32.762.553 | 13,21 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | | | 17.871.410 | 7,21 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | | | (17.872.941) | (7,21) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | | | 247.932.821 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | | | % des Gesamt-vermö-gens |
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | | | 12,32 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | | | 80,93 |
| Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | | | 6,72 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 0,03 |
| | | | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Merrill Lynch International.

L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|---|------------------------------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 87,75 %) | | | |
| 15.904.700 | Citigroup Global Markets Limited | 15.904.700 | 84,46 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | 15.904.700 | 84,46 |
| Nominal- betrag | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens |
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: (1,00 %)) | | | |
| 17.160.431 | Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR ¹ | 1.682.131 | 8,93 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | 1.682.131 | 8,93 |
| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 5,26 %) | | | |
| 2.902.430 | BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund | 2.902.430 | 15,41 |
| Geldmarktinstrumente insgesamt | | 2.902.430 | 15,41 |
| Gesamtanlagen | | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | 15.904.700 | 84,46 |
| Geldmarktinstrumente | | 2.902.430 | 15,41 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | 1.682.131 | 8,93 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | (1.657.897) | (8,80) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 18.831.364 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamt- vermö- gens |
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | 14,16 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | 77,60 |
| Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | 8,21 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | 0,03 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,93 %) | | | |
| 974.774 | 3D Systems Corp | 8.529.273 | 0,97 |
| 369.912 | ABB Ltd | 8.927.198 | 1,01 |
| 852.707 | Advantech Co Ltd | 8.590.499 | 0,98 |
| 225.952 | AeroVironment Inc | 13.950.276 | 1,58 |
| 562.361 | Airtac International Group | 8.751.419 | 0,99 |
| 269.900 | Amano Corp | 8.282.643 | 0,94 |
| 155.143 | Ambarella Inc | 9.395.460 | 1,07 |
| 88.880 | Aptiv Plc | 8.440.934 | 0,96 |
| 554.161 | ATS Automation Tooling Systems Inc | 9.158.130 | 1,04 |
| 46.477 | Autodesk Inc | 8.526.670 | 0,97 |
| 174.907 | BioTelemetry Inc | 8.098.194 | 0,92 |
| 1.021.307 | Blue Prism Group plc | 15.329.223 | 1,74 |
| 343.266 | Brooks Automation Inc | 14.403.441 | 1,64 |
| 124.059 | Cadence Design Systems Inc | 8.604.732 | 0,98 |
| 254.660 | Cargotec Oyj - Class B | 8.644.121 | 0,98 |
| 274.800 | Cognex Corp | 15.399.792 | 1,75 |
| 232.497 | Daifuku Co Ltd | 14.248.259 | 1,62 |
| 246.836 | Daihen Corp | 8.222.186 | 0,93 |
| 51.912 | Dassault Systemes SE | 8.539.489 | 0,97 |
| 50.447 | Deere & Co | 8.740.447 | 0,99 |
| 1.795.190 | Delta Electronics Inc | 9.072.661 | 1,03 |
| 275.092 | Duerr AG | 9.380.890 | 1,07 |
| 680.817 | Elektro AB | 8.971.122 | 1,02 |
| 72.720 | FANUC Corp | 13.603.839 | 1,54 |
| 163.739 | FARO Technologies Inc | 8.244.259 | 0,94 |
| 263.912 | FLIR Systems Inc | 13.741.898 | 1,56 |
| 460.588 | Fuji Corp/Aichi | 8.523.047 | 0,97 |
| 256.304 | GEA Group AG | 8.481.276 | 0,96 |
| 1.015.900 | Global Unichip Corp | 8.167.321 | 0,93 |
| 145.756 | Globus Medical Inc | 8.582.113 | 0,97 |

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,93 %) (Fortsetzung) | | | |
| 747.292 | Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd 'A' | 3.512.387 | 0,40 |
| 379.769 | Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A' | 2.180.785 | 0,25 |
| 322.336 | Harmonic Drive Systems Inc | 15.631.104 | 1,78 |
| 144.866 | Hexagon AB | 8.124.619 | 0,92 |
| 1.591.751 | Hiwin Technologies Corp | 14.920.833 | 1,69 |
| 943.984 | Hollysys Automation Technologies Ltd | 15.490.777 | 1,76 |
| 721.000 | Iflytek Co Ltd 'A' | 3.568.913 | 0,41 |
| 25.528 | Illumina Inc | 8.468.659 | 0,96 |
| 24.116 | Intuitive Surgical Inc | 14.256.173 | 1,62 |
| 99.464 | IPG Photonics Corp | 14.414.323 | 1,64 |
| 311.469 | iRobot Corp | 15.769.675 | 1,79 |
| 182.463 | Isra Vision AG | 7.958.953 | 0,90 |
| 284.000 | Jenoptik AG | 8.122.619 | 0,92 |
| 75.186 | John Bean Technologies Corp | 8.470.455 | 0,96 |
| 84.518 | Kardex AG | 14.226.395 | 1,62 |
| 39.644 | Keyence Corp | 14.040.921 | 1,59 |
| 120.883 | KION Group AG | 8.352.994 | 0,95 |
| 170.915 | Koh Young Technology Inc | 15.592.141 | 1,77 |
| 202.394 | Krones AG | 15.334.857 | 1,74 |
| 101.848 | Manhattan Associates Inc | 8.122.378 | 0,92 |
| 512.881 | Materialise NV ADR | 9.390.851 | 1,07 |
| 84.390 | Microchip Technology Inc | 8.837.321 | 1,00 |
| 593.428 | Mitsubishi Electric Corp | 8.182.669 | 0,93 |
| 465.856 | Nabtesco Corp | 13.996.038 | 1,59 |
| 181.220 | Nachi-Fujikoshi Corp | 8.029.207 | 0,91 |
| 199.194 | National Instruments Corp | 8.433.874 | 0,96 |
| 49.710 | Nordson Corp | 8.094.776 | 0,92 |
| 94.450 | Novanta Inc | 8.353.158 | 0,95 |
| 465.864 | Nuance Communications Inc | 8.306.355 | 0,94 |
| 66.559 | NVIDIA Corp | 15.661.333 | 1,78 |

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------------------------|--------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,93 %) (Fortsetzung) | | | |
| 521.223 | Ocado Group Plc | 8.831.369 | 1,00 |
| 102.236 | Omniceil Inc | 8.354.726 | 0,95 |
| 235.388 | Omron Corp | 13.905.595 | 1,58 |
| 542.610 | Optex Group Co Ltd | 8.263.347 | 0,94 |
| 110.081 | PTC Inc | 8.243.966 | 0,94 |
| 199.338 | QIAGEN NV | 6.737.624 | 0,77 |
| 99.430 | QUALCOMM Inc | 8.772.709 | 1,00 |
| 238.054 | Raven Industries Inc | 8.203.341 | 0,93 |
| 163.049 | Renishaw Plc | 8.138.848 | 0,92 |
| 71.258 | Rockwell Automation Inc | 14.441.859 | 1,64 |
| 83.274 | Schneider Electric SE | 8.552.810 | 0,97 |
| 30.636 | ServiceNow Inc | 8.649.156 | 0,98 |
| 1.028.310 | Siasun Robot & Automation Co Ltd 'A' | 2.066.738 | 0,23 |
| 64.580 | Siemens AG | 8.447.951 | 0,96 |
| 18.115 | SMC Corp/Japan | 8.382.821 | 0,95 |
| 437.727 | Stratasys Ltd | 8.853.029 | 1,01 |
| 30.257 | Tecan Group AG | 8.498.706 | 0,97 |
| 23.998 | Teledyne Technologies Inc | 8.316.267 | 0,94 |
| 130.346 | Teradyne Inc | 8.888.294 | 1,01 |
| 304.049 | THK Co Ltd | 8.303.816 | 0,94 |
| 631.133 | Topcon Corp | 8.264.108 | 0,94 |
| 315.241 | Toshiba Machine Co Ltd | 8.586.272 | 0,97 |
| 206.346 | Trimble Inc | 8.602.565 | 0,98 |
| 60.170 | Varian Medical Systems Inc | 8.544.742 | 0,97 |
| 519.853 | Vocera Communications Inc | 10.792.148 | 1,23 |
| 90.728 | Xilinx Inc | 8.870.477 | 1,01 |
| 507.135 | Yango Group Co Ltd 'A' | 2.230.724 | 0,25 |
| 384.613 | Yaskawa Electric Corp | 14.758.093 | 1,68 |
| 462.080 | Yokogawa Electric Corp | 8.201.997 | 0,93 |
| 54.966 | Zebra Technologies Corp | 14.040.515 | 1,59 |
| Stammaktien insgesamt | | 879.140.968 | 99,84 |

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Gesamtanlagen | | |
|--|--------------------|---------------|
| Stammaktien | 879.140.968 | 99,84 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 1.385.050 | 0,16 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 880.526.018 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | | % des Gesamtvermögens |
|--|--|------------------------------|
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 98,20 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 1,80 |
| | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | |

L&G Cyber Security UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,35 %) | | | |
| 2.061.835 | A10 Networks Inc | 14.164.806 | 1,33 |
| 354.803 | Ahnlab Inc | 20.095.634 | 1,88 |
| 361.924 | Akamai Technologies Inc | 31.262.995 | 2,93 |
| 163.650 | Atos SE | 13.652.118 | 1,28 |
| 3.138.163 | Avast Plc '144A' | 18.824.170 | 1,77 |
| 2.081.708 | BAE Systems Plc | 15.575.731 | 1,46 |
| 204.274 | Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A | 14.530.010 | 1,36 |
| 63.423 | CACI International Inc - Class A | 15.855.116 | 1,49 |
| 294.103 | Check Point Software Technologies Ltd | 32.633.669 | 3,06 |
| 647.738 | Cisco Systems Inc | 31.065.515 | 2,91 |
| 315.129 | CyberArk Software Ltd | 36.737.739 | 3,44 |
| 101.179 | F5 Networks Inc | 14.129.647 | 1,33 |
| 255.447 | FFRI Inc | 6.386.467 | 0,60 |
| 13.552.671 | Fingerprint Cards AB - Class B | 27.334.058 | 2,56 |
| 2.398.464 | FireEye Inc | 39.646.610 | 3,72 |
| 869.754 | ForeScout Technologies Inc | 28.527.931 | 2,67 |
| 422.587 | Fortinet Inc | 45.115.388 | 4,23 |
| 78.369 | General Dynamics Corp | 13.820.373 | 1,30 |
| 1.297.955 | Juniper Networks Inc | 31.968.632 | 3,00 |
| 169.021 | Leidos Holdings Inc | 16.545.466 | 1,55 |
| 203.615 | ManTech International Corp/VA - Class A | 16.264.766 | 1,53 |
| 382.747 | Mimecast Ltd | 16.603.565 | 1,56 |
| 1.474.179 | Mitek Systems Inc | 11.277.469 | 1,06 |
| 2.209.398 | MobileIron Inc | 10.737.674 | 1,01 |
| 5.271.620 | NCC Group Plc | 15.747.970 | 1,48 |
| 1.388.949 | NetScout Systems Inc | 33.432.002 | 3,13 |
| 1.389.264 | NortonLifeLock Inc | 35.454.017 | 3,32 |
| 139.603 | Okta Inc | 16.105.998 | 1,51 |
| 1.444.718 | OneSpan Inc | 24.733.572 | 2,32 |
| 159.169 | Palo Alto Networks Inc | 36.807.831 | 3,45 |
| 349.899 | Parsons Corp | 14.443.831 | 1,35 |

L&G Cyber Security UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|----------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,35 %) (Fortsetzung) | | | |
| 253.940 | Proofpoint Inc | 29.147.233 | 2,73 |
| 421.430 | Qualys Inc | 35.134.619 | 3,29 |
| 1.333.735 | Radware Ltd | 34.383.688 | 3,22 |
| 693.410 | Rapid7 Inc | 38.844.828 | 3,64 |
| 755.492 | SailPoint Technologies Holding Inc | 17.829.611 | 1,67 |
| 164.073 | Science Applications International Corp | 14.277.632 | 1,34 |
| 338.729 | SecureWorks Corp | 5.643.225 | 0,53 |
| 776.322 | SolarWinds Corp | 14.400.773 | 1,35 |
| 272.864 | Splunk Inc | 40.866.841 | 3,83 |
| 612.572 | Tenable Holdings Inc | 14.677.225 | 1,38 |
| 122.693 | Thales SA | 12.741.886 | 1,19 |
| 688.412 | Trend Micro Inc/Japan | 35.473.716 | 3,33 |
| 359.874 | Tufin Software Technologies Ltd | 6.330.184 | 0,59 |
| 237.706 | Varonis Systems Inc | 18.472.133 | 1,73 |
| 321.193 | Verint Systems Inc | 17.781.245 | 1,67 |
| 13.228 | VeriSign Inc | 2.548.771 | 0,24 |
| 1.898.264 | Zix Corp | 12.870.230 | 1,21 |
| 280.277 | Zscaler Inc | 13.032.881 | 1,22 |
| | Stammaktien insgesamt | 1.063.937.491 | 99,75 |
| Gesamtanlagen | | | |
| | Stammaktien | 1.063.937.491 | 99,75 |
| | Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 2.680.563 | 0,25 |
| | Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 1.066.618.054 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamtvermögens |
| | Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 99,69 |
| | Sonstige Vermögenswerte | | 0,31 |
| | | | 100,00 |
| | Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | |

L&G All Commodities UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Kupon- satz | Fälligkeits- termin | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|-------------------|----------------|------------------------|-------------------|------------------------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 91,86 %) | | | | | |
| 52.900.070 | Barclays Bank Plc | 1,81 % | 23.01.2020 | 52.900.070 | 94,05 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | | | 52.900.070 | 94,05 |

| Nominal- betrag | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover- mögens | |
|--|---|---|------------------------------|-------------|
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,65 %) | | | | |
| 55.883.822 | Bloomberg Commodity Index Total Return ¹ | 20.01.2020 | 369.464 | 0,66 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | | 369.464 | 0,66 |

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens | |
|---|--|--------------|------------------------------|-------------|
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 8,72 %) | | | | |
| 3.655.846 | BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund | 3.655.846 | 6,50 | |
| Geldmarktinstrumente insgesamt | | | 3.655.846 | 6,50 |

| Gesamtanlagen | | | |
|----------------------|--|-------------------|---------------|
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 52.900.070 | 94,05 |
| | Geldmarktinstrumente | 3.655.846 | 6,50 |
| | Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | 369.464 | 0,66 |
| | Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | (676.407) | (1,21) |
| | Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 56.248.973 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamt- vermö- gens |
|--|--|--|------------------------------------|
| Wertpapiere, die zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | 6,42 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | 92,90 |
| Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | 0,65 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | 0,03 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW- Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Kupon-satz | Fälligkeits-termin | Wert US\$ | % des Nettover-mögens |
|--|-------------------|------------|--------------------|------------------|-----------------------|
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 89,73 %) | | | | | |
| 8.454.553 | Barclays Bank Plc | 1,82 % | 23.01.2020 | 8.454.553 | 92,08 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt | | | | 8.454.553 | 92,08 |

| Nominal-betrag | Beschreibung | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover-mögens | |
|--|---|--------------------------------|-----------------------|-------------|
| Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 1,96 %) | | | | |
| 9.144.736 | Bloomberg ex-Agriculture and Livestock 15/30 Capped 3 Month Forward Total Return ¹ | 20.01.2020 | 41.347 | 0,45 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | | | 41.347 | 0,45 |

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover-mögens |
|---|--|----------------|-----------------------|
| Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 8,33 %) | | | |
| 688.775 | BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund | 688.775 | 7,50 |
| Geldmarktinstrumente insgesamt | | 688.775 | 7,50 |

| Gesamtanlagen | | | |
|--|---|------------------|---------------|
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 8.454.553 | 92,08 |
| | Geldmarktinstrumente | 688.775 | 7,50 |
| | Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten | 41.347 | 0,45 |
| | Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | (2.669) | (0,03) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 9.182.006 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamtver-mögens |
|---|--|--|------------------------|
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden | | | 7,50 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | 92,02 |
| Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | 0,45 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | 0,03 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

¹ Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

L&G L&G Battery Value-Chain UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|-------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) | | | |
| 77.039 | ABB Ltd | 1.859.206 | 3,60 |
| 24.500 | Albemarle Corp | 1.789.480 | 3,47 |
| 20.139 | Bayerische Motoren Werke AG | 1.653.374 | 3,20 |
| 330.273 | BYD Co Ltd 'H' | 1.646.743 | 3,19 |
| 35.475 | DMG Mori AG | 1.686.375 | 3,27 |
| 23.810 | EnerSys | 1.781.702 | 3,45 |
| 57.637 | Evonik Industries AG | 1.760.387 | 3,41 |
| 17.047 | FMC Corp | 1.701.632 | 3,30 |
| 2.217.403 | Galaxy Resources Ltd | 1.441.825 | 2,79 |
| 144.577 | General Electric Co | 1.613.479 | 3,12 |
| 80.931 | GS Yuasa Corp | 1.761.231 | 3,41 |
| 53.700 | Hitachi Chemical Co Ltd | 2.260.662 | 4,38 |
| 5.968 | LG Chem Ltd | 1.638.497 | 3,17 |
| 114.117 | Mitsubishi Electric Corp | 1.573.538 | 3,05 |
| 41.900 | NEC Corp | 1.742.700 | 3,37 |
| 97.702 | NGK Insulators Ltd | 1.711.751 | 3,31 |
| 11.119 | Nidec Corp | 1.535.225 | 2,97 |
| 256.046 | Nissan Motor Co Ltd | 1.498.696 | 2,90 |
| 870.271 | Orocobre Ltd | 1.621.163 | 3,14 |
| 177.875 | Panasonic Corp | 1.685.045 | 3,26 |
| 8.117 | Samsung SDI Co Ltd | 1.656.459 | 3,21 |
| 33.537 | Sanyo Chemical Industries Ltd | 1.672.606 | 3,24 |
| 13.279 | Siemens AG | 1.737.076 | 3,36 |
| 11.900 | SK Innovation Co Ltd | 1.543.517 | 2,99 |
| 62.496 | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR | 1.668.018 | 3,23 |
| 27.700 | Sony Corp | 1.886.429 | 3,65 |
| 114.651 | Sumitomo Electric Industries Ltd | 1.742.842 | 3,38 |
| 15.900 | TDK Corp | 1.812.753 | 3,51 |
| 4.941 | Tesla Inc | 2.066.969 | 4,00 |
| 50.495 | Toshiba Corp | 1.721.499 | 3,33 |
| Stammaktien insgesamt | | 51.470.879 | 99,66 |

L&G L&G Battery Value-Chain UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Gesamtanlagen | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| Stammaktien | 51.470.879 | 99,66 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 176.860 | 0,34 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 51.647.739 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | % des Gesamt- vermö- gens |
|--|------------------------------------|
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | 98,80 |
| Sonstige Vermögenswerte | 1,20 |
| | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | |

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------|------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,92 %) | | | |
| 2.542 | Alexion Pharmaceuticals Inc | 274.917 | 3,33 |
| 2.188 | BeiGene Ltd ADR | 362.683 | 4,40 |
| 1.175 | Biogen Inc | 348.658 | 4,23 |
| 3.659 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 309.368 | 3,75 |
| 1.592 | CSL Ltd | 308.603 | 3,74 |
| 4.706 | Emergent BioSolutions Inc | 253.889 | 3,08 |
| 8.528 | Grifols SA | 300.864 | 3,65 |
| 7.316 | H Lundbeck A/S | 279.584 | 3,39 |
| 16.567 | Halozyne Therapeutics Inc | 293.733 | 3,56 |
| 9.742 | Horizon Therapeutics Plc | 352.660 | 4,28 |
| 3.331 | Incyte Corp | 290.863 | 3,53 |
| 4.274 | Ionis Pharmaceuticals Inc | 258.192 | 3,13 |
| 2.707 | Ipsen SA | 240.046 | 2,91 |
| 2.087 | Jazz Pharmaceuticals Plc | 311.547 | 3,78 |
| 3.009 | Ligand Pharmaceuticals Inc | 313.809 | 3,81 |
| 141.130 | Mallinckrodt Plc | 492.544 | 5,97 |
| 3.234 | Nippon Shinyaku Co Ltd | 281.813 | 3,42 |
| 2.928 | Novartis AG | 277.872 | 3,37 |
| 6.227 | PTC Therapeutics Inc | 299.083 | 3,63 |
| 904 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 339.434 | 4,12 |
| 22.366 | Retrophin Inc | 317.597 | 3,85 |
| 15.727 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | 301.877 | 3,66 |
| 15.792 | Swedish Orphan Biovitrum AB | 260.641 | 3,16 |
| 7.642 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | 304.625 | 3,69 |
| 5.896 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | 251.818 | 3,05 |
| 3.281 | United Therapeutics Corp | 288.991 | 3,51 |
| 1.455 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 318.572 | 3,86 |
| | Stammaktien insgesamt | 8.234.283 | 99,86 |

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Gesamtanlagen | | |
|--|------------------|---------------|
| Stammaktien | 8.234.283 | 99,86 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 11.223 | 0,14 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 8.245.506 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | | % des Gesamtvermögens |
|--|--|------------------------------|
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 99,82 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 0,18 |
| | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | |

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,83 %) | | | |
| 1.195 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | 253.459 | 3,31 |
| 119 | Amazon.com Inc | 219.893 | 2,87 |
| 50.753 | Bollore SA | 221.610 | 2,89 |
| 18.765 | bpost SA | 216.952 | 2,83 |
| 10.223 | Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA | 230.650 | 3,01 |
| 1.694 | CJ Logistics Corp | 227.048 | 2,97 |
| 5.127 | Descartes Systems Group Inc/The | 219.435 | 2,87 |
| 6.302 | Deutsche Post AG | 240.582 | 3,14 |
| 2.194 | DSV PANALPINA A/S | 253.050 | 3,30 |
| 2.779 | Expeditors International of Washington Inc | 216.818 | 2,83 |
| 1.420 | FedEx Corp | 214.718 | 2,80 |
| 6.850 | Hitachi Transport System Ltd | 193.823 | 2,53 |
| 22.900 | Japan Post Holdings Co Ltd | 216.199 | 2,82 |
| 6.957 | JD.com Inc ADR | 245.095 | 3,20 |
| 14.300 | Kintetsu World Express Inc | 251.064 | 3,28 |
| 1.359 | Kuehne + Nagel International AG | 229.033 | 2,99 |
| 1.863.684 | Li & Fung Ltd | 203.307 | 2,66 |
| 8.492 | Mainfreight Ltd | 243.489 | 3,18 |
| 2.385 | Manhattan Associates Inc | 190.204 | 2,48 |
| 4.000 | Nippon Express Co Ltd | 236.301 | 3,09 |
| 12.000 | Nippon Yusen KK | 218.744 | 2,86 |
| 12.325 | Ocado Group Plc | 208.829 | 2,73 |
| 3.633 | Oracle Corp | 192.476 | 2,51 |
| 22.200 | Rakuten Inc | 191.001 | 2,49 |
| 4.096 | Ryder System Inc | 222.454 | 2,91 |
| 1.619 | SAP SE | 218.657 | 2,86 |

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,83 %) (Fortsetzung) | | | |
| 26.600 | Senko Group Holdings Co Ltd | 228.367 | 2,98 |
| 652.000 | Sinotrans Ltd 'H' | 221.746 | 2,90 |
| 1.816 | SYNNEX Corp | 233.901 | 3,05 |
| 1.781 | United Parcel Service Inc - Class B | 208.484 | 2,72 |
| 22.913 | Vipshop Holdings Ltd ADR | 324.677 | 4,24 |
| 1.719 | Walmart Inc | 204.286 | 2,67 |
| 2.791 | XPO Logistics Inc | 222.443 | 2,90 |
| 4.497 | Zalando SE '144A' | 228.059 | 2,98 |
| | Stammaktien insgesamt | 7.646.854 | 99,85 |
| Gesamtanlagen | | | |
| | Stammaktien | 7.646.854 | 99,85 |
| | Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 11.229 | 0,15 |
| | Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 7.658.083 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamtvermögens |
| | Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 99,81 |
| | Sonstige Vermögenswerte | | 0,19 |
| | | | 100,00 |
| | Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) | | | |
| 3.057 | 3M Co | 539.316 | 0,39 |
| 9.261 | Abbott Laboratories | 804.410 | 0,58 |
| 7.829 | AbbVie Inc | 693.180 | 0,50 |
| 191 | ABIOMED Inc | 32.583 | 0,02 |
| 3.308 | Accenture Plc - Class A | 696.566 | 0,50 |
| 4.023 | Activision Blizzard Inc | 239.047 | 0,17 |
| 2.520 | Adobe Inc | 831.121 | 0,60 |
| 305 | Advance Auto Parts Inc | 48.849 | 0,04 |
| 5.596 | Advanced Micro Devices Inc | 256.633 | 0,18 |
| 3.503 | Aflac Inc | 185.309 | 0,13 |
| 1.727 | Agilent Technologies Inc | 147.330 | 0,11 |
| 1.166 | Air Products & Chemicals Inc | 273.998 | 0,20 |
| 860 | Akamai Technologies Inc | 74.287 | 0,05 |
| 531 | Alaska Air Group Inc | 35.975 | 0,03 |
| 466 | Albemarle Corp | 34.037 | 0,02 |
| 674 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | 108.905 | 0,08 |
| 1.123 | Alexion Pharmaceuticals Inc | 121.452 | 0,09 |
| 387 | Align Technology Inc | 107.988 | 0,08 |
| 61 | Alleghany Corp | 48.774 | 0,04 |
| 1.677 | Allergan Plc | 320.592 | 0,23 |
| 212 | Alliance Data Systems Corp | 23.786 | 0,02 |
| 1.439 | Alliant Energy Corp | 78.742 | 0,06 |
| 1.636 | Allstate Corp/The | 183.968 | 0,13 |
| 2.290 | Ally Financial Inc | 69.982 | 0,05 |
| 1.721 | Alphabet Inc | 2.301.011 | 1,65 |
| 1.444 | Alphabet Inc - Class A | 1.934.079 | 1,39 |
| 1.581 | Altice USA Inc | 43.225 | 0,03 |
| 9.869 | Altria Group Inc | 492.562 | 0,35 |
| 2.194 | Amazon.com Inc | 4.054.161 | 2,92 |
| 9.766 | Amcort Plc | 105.863 | 0,08 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 589 | Amdocs Ltd | 42.520 | 0,03 |
| 1.435 | Ameren Corp | 110.208 | 0,08 |
| 1.833 | American Airlines Group Inc | 52.570 | 0,04 |
| 2.495 | American Electric Power Co Inc | 235.802 | 0,17 |
| 3.257 | American Express Co | 405.464 | 0,29 |
| 559 | American Financial Group Inc/OH | 61.294 | 0,04 |
| 4.669 | American International Group Inc | 239.660 | 0,17 |
| 2.317 | American Tower Corp (REIT) | 532.493 | 0,38 |
| 863 | American Water Works Co Inc | 106.020 | 0,08 |
| 707 | Ameriprise Financial Inc | 117.772 | 0,08 |
| 863 | AmerisourceBergens Corp - Class A | 73.372 | 0,05 |
| 1.204 | AMETEK Inc | 120.087 | 0,09 |
| 3.154 | Amgen Inc | 760.335 | 0,55 |
| 1.552 | Amphenol Corp - Class A | 167.973 | 0,12 |
| 1.877 | Analog Devices Inc | 223.063 | 0,16 |
| 7.792 | Annaly Capital Management Inc (REIT) | 73.401 | 0,05 |
| 416 | ANSYS Inc | 107.083 | 0,08 |
| 1.321 | Anthem Inc | 398.982 | 0,29 |
| 627 | AO Smith Corp | 29.870 | 0,02 |
| 1.257 | Aon Plc | 261.821 | 0,19 |
| 1.680 | Apache Corp | 42.991 | 0,03 |
| 1.192 | Apollo Global Management Inc - Class A | 56.870 | 0,04 |
| 20.963 | Apple Inc | 6.155.785 | 4,43 |
| 4.817 | Applied Materials Inc | 294.030 | 0,21 |
| 1.404 | Aptiv Plc | 133.338 | 0,10 |
| 1.063 | Aramark | 46.134 | 0,03 |
| 2.066 | Arch Capital Group Ltd | 88.611 | 0,06 |
| 2.776 | Archer-Daniels-Midland Co | 128.668 | 0,09 |
| 1.908 | Arconic Inc | 58.709 | 0,04 |
| 302 | Arista Networks Inc | 61.427 | 0,04 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|----------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 963 | Arthur J Gallagher & Co | 91.706 | 0,07 |
| 38.423 | AT&T Inc | 1.501.571 | 1,08 |
| 695 | Athene Holding Ltd - Class A | 32.686 | 0,02 |
| 584 | Atlassian Corp Plc | 70.279 | 0,05 |
| 607 | Atmos Energy Corp | 67.899 | 0,05 |
| 1.176 | Autodesk Inc | 215.749 | 0,16 |
| 367 | Autoliv Inc | 30.978 | 0,02 |
| 2.121 | Automatic Data Processing Inc | 361.630 | 0,26 |
| 125 | AutoZone Inc | 148.914 | 0,11 |
| 695 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | 145.741 | 0,10 |
| 211 | Avangrid Inc | 10.795 | 0,01 |
| 882 | Axalta Coating Systems Ltd | 26.813 | 0,02 |
| 4.303 | Baker Hughes Co - Class A | 110.286 | 0,08 |
| 1.757 | Ball Corp | 113.625 | 0,08 |
| 43.719 | Bank of America Corp | 1.539.783 | 1,11 |
| 4.346 | Bank of New York Mellon Corp/The | 218.734 | 0,16 |
| 2.610 | Baxter International Inc | 218.248 | 0,16 |
| 1.386 | Becton Dickinson and Co | 376.950 | 0,27 |
| 7.016 | Berkshire Hathaway Inc - Class B | 1.589.124 | 1,14 |
| 1.321 | Best Buy Co Inc | 115.984 | 0,08 |
| 966 | Biogen Inc | 286.641 | 0,21 |
| 1.010 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 85.395 | 0,06 |
| 559 | BlackRock Inc | 281.009 | 0,20 |
| 3.433 | Blackstone Group Inc/The | 192.042 | 0,14 |
| 2.792 | Boeing Co/The | 909.522 | 0,65 |
| 222 | Booking Holdings Inc | 455.928 | 0,33 |
| 902 | BorgWarner Inc | 39.129 | 0,03 |
| 689 | Boston Properties Inc (REIT) | 94.986 | 0,07 |
| 7.129 | Boston Scientific Corp | 322.373 | 0,23 |
| 8.615 | Bristol-Myers Squibb Co | 552.997 | 0,40 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 2.049 | Broadcom Inc | 647.525 | 0,47 |
| 640 | Broadridge Financial Solutions Inc | 79.066 | 0,06 |
| 535 | Brown-Forman Corp | 33.582 | 0,02 |
| 1.179 | Brown-Forman Corp | 79.700 | 0,06 |
| 598 | Bunge Ltd | 34.415 | 0,02 |
| 1.859 | Cabot Oil & Gas Corp | 32.365 | 0,02 |
| 1.392 | Cadence Design Systems Inc | 96.549 | 0,07 |
| 841 | Campbell Soup Co | 41.562 | 0,03 |
| 2.371 | Capital One Financial Corp | 244.000 | 0,18 |
| 1.822 | Cardinal Health Inc | 92.157 | 0,07 |
| 892 | CarMax Inc | 78.202 | 0,06 |
| 2.131 | Carnival Corp | 108.319 | 0,08 |
| 3.011 | Caterpillar Inc | 444.664 | 0,32 |
| 587 | Cboe Global Markets Inc | 70.440 | 0,05 |
| 1.888 | CBRE Group Inc - Class A | 115.715 | 0,08 |
| 753 | CDW Corp/DE | 107.559 | 0,08 |
| 582 | Celanese Corp - Class A | 71.656 | 0,05 |
| 2.206 | Centene Corp | 138.691 | 0,10 |
| 2.690 | CenterPoint Energy Inc | 73.356 | 0,05 |
| 5.696 | CenturyLink Inc | 75.244 | 0,05 |
| 1.634 | Cerner Corp | 119.919 | 0,09 |
| 602 | CH Robinson Worldwide Inc | 47.076 | 0,03 |
| 6.062 | Charles Schwab Corp/The | 288.309 | 0,21 |
| 829 | Charter Communications Inc | 402.131 | 0,29 |
| 1.021 | Cheniere Energy Inc | 62.352 | 0,04 |
| 10.001 | Chevron Corp | 1.205.220 | 0,87 |
| 146 | Chipotle Mexican Grill Inc - Class A | 122.218 | 0,09 |
| 2.008 | Chubb Ltd | 312.565 | 0,22 |
| 1.291 | Church & Dwight Co Inc | 90.809 | 0,07 |
| 1.999 | Cigna Corp | 408.775 | 0,29 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 882 | Cincinnati Financial Corp | 92.742 | 0,07 |
| 501 | Cintas Corp | 134.809 | 0,10 |
| 22.468 | Cisco Systems Inc | 1.077.565 | 0,77 |
| 11.920 | Citigroup Inc | 952.289 | 0,68 |
| 2.495 | Citizens Financial Group Inc | 101.322 | 0,07 |
| 692 | Citrix Systems Inc | 76.743 | 0,06 |
| 684 | Clorox Co/The | 105.021 | 0,08 |
| 1.823 | CME Group Inc | 365.913 | 0,26 |
| 1.320 | CMS Energy Corp | 82.949 | 0,06 |
| 20.186 | Coca-Cola Co/The | 1.117.295 | 0,80 |
| 2.805 | Cognizant Technology Solutions Corp | 173.966 | 0,13 |
| 4.378 | Colgate-Palmolive Co | 301.382 | 0,22 |
| 23.745 | Comcast Corp | 1.067.813 | 0,77 |
| 704 | Comerica Inc | 50.512 | 0,04 |
| 2.544 | Conagra Brands Inc | 87.107 | 0,06 |
| 1.156 | Concho Resources Inc | 101.231 | 0,07 |
| 5.721 | ConocoPhillips | 372.037 | 0,27 |
| 1.683 | Consolidated Edison Inc | 152.261 | 0,11 |
| 790 | Constellation Brands Inc - Class A | 149.902 | 0,11 |
| 380 | Continental Resources Inc/OK | 13.034 | 0,01 |
| 267 | Cooper Cos Inc/The | 85.784 | 0,06 |
| 1.070 | Copart Inc | 97.306 | 0,07 |
| 4.087 | Corning Inc | 118.973 | 0,09 |
| 3.965 | Corteva Inc | 117.205 | 0,08 |
| 192 | CoStar Group Inc | 114.874 | 0,08 |
| 2.277 | Costco Wholesale Corp | 669.256 | 0,48 |
| 2.020 | Coty Inc | 22.725 | 0,02 |
| 2.118 | Crown Castle International Corp (REIT) | 301.074 | 0,22 |
| 4.067 | CSX Corp | 294.288 | 0,21 |
| 832 | Cummins Inc | 148.895 | 0,11 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 6.904 | CVS Health Corp | 512.898 | 0,37 |
| 3.401 | Danaher Corp | 521.985 | 0,38 |
| 681 | Darden Restaurants Inc | 74.236 | 0,05 |
| 546 | DaVita Inc | 40.966 | 0,03 |
| 1.621 | Deere & Co | 280.854 | 0,20 |
| 1.321 | Dell Technologies Inc | 67.886 | 0,05 |
| 3.081 | Delta Air Lines Inc | 180.177 | 0,13 |
| 1.249 | DENTSPLY SIRONA Inc | 70.681 | 0,05 |
| 2.015 | Devon Energy Corp | 52.330 | 0,04 |
| 871 | Diamondback Energy Inc | 80.881 | 0,06 |
| 1.088 | Digital Realty Trust Inc (REIT) | 130.277 | 0,09 |
| 1.631 | Discover Financial Services | 138.341 | 0,10 |
| 3.142 | Discovery Inc | 95.800 | 0,07 |
| 1.312 | DISH Network Corp - Class A | 46.537 | 0,03 |
| 1.302 | Dollar General Corp | 203.086 | 0,15 |
| 1.161 | Dollar Tree Inc | 109.192 | 0,08 |
| 4.034 | Dominion Energy Inc | 334.096 | 0,24 |
| 184 | Domino's Pizza Inc | 54.056 | 0,04 |
| 765 | Dover Corp | 88.174 | 0,06 |
| 3.842 | Dow Inc | 210.273 | 0,15 |
| 1.901 | DR Horton Inc | 100.278 | 0,07 |
| 1.283 | Dropbox Inc | 22.979 | 0,02 |
| 914 | DTE Energy Co | 118.701 | 0,09 |
| 3.731 | Duke Energy Corp | 340.304 | 0,24 |
| 1.513 | Duke Realty Corp (REIT) | 52.456 | 0,04 |
| 4.045 | DuPont de Nemours Inc | 259.689 | 0,19 |
| 1.241 | DXC Technology Co | 46.649 | 0,03 |
| 1.110 | E*TRADE Financial Corp | 50.361 | 0,04 |
| 549 | Eastman Chemical Co | 43.514 | 0,03 |
| 2.225 | Eaton Corp Plc | 210.752 | 0,15 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 4.043 | eBay Inc | 145.993 | 0,11 |
| 1.310 | Ecolab Inc | 252.817 | 0,18 |
| 1.895 | Edison International | 142.902 | 0,10 |
| 1.098 | Edwards Lifesciences Corp | 256.152 | 0,18 |
| 2.043 | Elanco Animal Health Inc | 60.166 | 0,04 |
| 1.533 | Electronic Arts Inc | 164.813 | 0,12 |
| 4.466 | Eli Lilly & Co | 586.966 | 0,42 |
| 3.170 | Emerson Electric Co | 241.744 | 0,17 |
| 987 | Entergy Corp | 118.243 | 0,09 |
| 2.982 | EOG Resources Inc | 249.772 | 0,18 |
| 662 | Equifax Inc | 92.759 | 0,07 |
| 441 | Equinix Inc (REIT) | 257.412 | 0,19 |
| 1.854 | Equity Residential (REIT) | 150.026 | 0,11 |
| 336 | Essex Property Trust Inc (REIT) | 101.089 | 0,07 |
| 1.122 | Estee Lauder Cos Inc/The - Class A | 231.738 | 0,17 |
| 175 | Everest Re Group Ltd | 48.447 | 0,03 |
| 1.112 | Evergy Inc | 72.380 | 0,05 |
| 1.592 | Eversource Energy | 135.431 | 0,10 |
| 5.019 | Exelon Corp | 228.816 | 0,16 |
| 764 | Expedia Group Inc | 82.619 | 0,06 |
| 759 | Expeditors International of Washington Inc | 59.217 | 0,04 |
| 670 | Extra Space Storage Inc (REIT) | 70.765 | 0,05 |
| 22.322 | Exxon Mobil Corp | 1.557.629 | 1,12 |
| 261 | F5 Networks Inc | 36.449 | 0,03 |
| 12.490 | Facebook Inc - Class A | 2.563.572 | 1,84 |
| 3.612 | Fastenal Co | 133.463 | 0,10 |
| 547 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | 70.415 | 0,05 |
| 1.265 | FedEx Corp | 191.281 | 0,14 |
| 1.165 | Fidelity National Financial Inc | 52.833 | 0,04 |
| 3.283 | Fidelity National Information Services Inc | 456.632 | 0,33 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 3.666 | Fifth Third Bancorp | 112.693 | 0,08 |
| 916 | First Republic Bank/CA | 107.584 | 0,08 |
| 2.771 | FirstEnergy Corp | 134.671 | 0,10 |
| 3.000 | Fiserv Inc | 346.890 | 0,25 |
| 436 | FleetCor Technologies Inc | 125.446 | 0,09 |
| 702 | FMC Corp | 70.074 | 0,05 |
| 20.283 | Ford Motor Co | 188.632 | 0,14 |
| 738 | Fortinet Inc | 78.789 | 0,06 |
| 1.550 | Fortive Corp | 118.404 | 0,09 |
| 624 | Fortune Brands Home & Security Inc | 40.772 | 0,03 |
| 3.460 | Fox Corp | 125.944 | 0,09 |
| 1.285 | Franklin Resources Inc | 33.384 | 0,02 |
| 1.253 | Gap Inc/The | 22.153 | 0,02 |
| 704 | Garmin Ltd | 68.682 | 0,05 |
| 470 | Gartner Inc | 72.427 | 0,05 |
| 1.358 | General Dynamics Corp | 239.483 | 0,17 |
| 45.393 | General Electric Co | 506.586 | 0,36 |
| 3.017 | General Mills Inc | 161.590 | 0,12 |
| 6.615 | General Motors Co | 242.109 | 0,17 |
| 621 | Genuine Parts Co | 65.969 | 0,05 |
| 6.536 | Gilead Sciences Inc | 424.709 | 0,31 |
| 1.550 | Global Payments Inc | 282.968 | 0,20 |
| 443 | Globe Life Inc | 46.626 | 0,03 |
| 1.831 | Goldman Sachs Group Inc/The | 421.002 | 0,30 |
| 4.352 | Halliburton Co | 106.493 | 0,08 |
| 1.767 | Hartford Financial Services Group Inc/The | 107.381 | 0,08 |
| 614 | Hasbro Inc | 64.845 | 0,05 |
| 1.420 | HCA Healthcare Inc | 209.890 | 0,15 |
| 754 | HD Supply Holdings Inc | 30.326 | 0,02 |
| 2.532 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | 87.278 | 0,06 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 652 | Henry Schein Inc | 43.501 | 0,03 |
| 765 | Hershey Co/The | 112.440 | 0,08 |
| 1.481 | Hess Corp | 98.946 | 0,07 |
| 7.244 | Hewlett Packard Enterprise Co | 114.890 | 0,08 |
| 1.504 | Hilton Worldwide Holdings Inc | 166.809 | 0,12 |
| 1.263 | Hologic Inc | 65.941 | 0,05 |
| 5.767 | Home Depot Inc/The | 1.259.397 | 0,91 |
| 3.786 | Honeywell International Inc | 670.122 | 0,48 |
| 1.207 | Hormel Foods Corp | 54.448 | 0,04 |
| 3.259 | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | 60.454 | 0,04 |
| 7.672 | HP Inc | 157.660 | 0,11 |
| 686 | Humana Inc | 251.433 | 0,18 |
| 6.763 | Huntington Bancshares Inc/OH | 101.986 | 0,07 |
| 184 | Huntington Ingalls Industries Inc | 46.162 | 0,03 |
| 398 | IAC/InterActiveCorp | 99.146 | 0,07 |
| 448 | IDEXX Laboratories Inc | 116.986 | 0,08 |
| 2.043 | IHS Markit Ltd | 153.940 | 0,11 |
| 1.468 | Illinois Tool Works Inc | 263.697 | 0,19 |
| 775 | Illumina Inc | 257.098 | 0,18 |
| 958 | Incyte Corp | 83.653 | 0,06 |
| 1.254 | Ingersoll-Rand Plc | 166.682 | 0,12 |
| 23.400 | Intel Corp | 1.400.490 | 1,01 |
| 313 | Interactive Brokers Group Inc | 14.592 | 0,01 |
| 2.923 | Intercontinental Exchange Inc | 270.524 | 0,19 |
| 4.685 | International Business Machines Corp | 627.977 | 0,45 |
| 552 | International Flavors & Fragrances Inc | 71.219 | 0,05 |
| 2.092 | International Paper Co | 96.337 | 0,07 |
| 1.672 | Interpublic Group of Cos Inc/The | 38.623 | 0,03 |
| 1.290 | Intuit Inc | 337.890 | 0,24 |
| 607 | Intuitive Surgical Inc | 358.828 | 0,26 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 2.958 | Invesco Ltd | 53.185 | 0,04 |
| 3.831 | Invitation Homes Inc (REIT) | 114.815 | 0,08 |
| 929 | IQVIA Holdings Inc | 143.540 | 0,10 |
| 1.244 | Iron Mountain Inc (REIT) | 39.646 | 0,03 |
| 256 | Jazz Pharmaceuticals Plc | 38.216 | 0,03 |
| 378 | JB Hunt Transport Services Inc | 44.143 | 0,03 |
| 481 | JM Smucker Co/The | 50.087 | 0,04 |
| 4.327 | Johnson Controls International plc | 176.152 | 0,13 |
| 16.412 | JPMorgan Chase & Co | 2.287.833 | 1,65 |
| 1.451 | Juniper Networks Inc | 35.738 | 0,03 |
| 521 | Kansas City Southern | 79.796 | 0,06 |
| 1.231 | Kellogg Co | 85.136 | 0,06 |
| 1.540 | Keurig Dr Pepper Inc | 44.583 | 0,03 |
| 5.560 | KeyCorp | 112.534 | 0,08 |
| 981 | Keysight Technologies Inc | 100.680 | 0,07 |
| 1.811 | Kimberly-Clark Corp | 249.103 | 0,18 |
| 1.807 | Kimco Realty Corp (REIT) | 37.423 | 0,03 |
| 10.564 | Kinder Morgan Inc/DE | 223.640 | 0,16 |
| 2.700 | KKR & Co Inc | 78.759 | 0,06 |
| 794 | KLA Corp | 141.467 | 0,10 |
| 3.278 | Kraft Heinz Co/The | 105.322 | 0,08 |
| 4.191 | Kroger Co/The | 121.497 | 0,09 |
| 1.172 | L3Harris Technologies Inc | 231.904 | 0,17 |
| 438 | Laboratory Corp of America Holdings | 74.096 | 0,05 |
| 763 | Lam Research Corp | 223.101 | 0,16 |
| 1.939 | Las Vegas Sands Corp | 133.869 | 0,10 |
| 280 | Lear Corp | 38.416 | 0,03 |
| 764 | Leidos Holdings Inc | 74.788 | 0,05 |
| 2.546 | Lennar Corp | 113.806 | 0,08 |
| 287 | Liberty Broadband Corp | 35.749 | 0,03 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 627 | Liberty Broadband Corp | 78.845 | 0,06 |
| 1.161 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM | 56.123 | 0,04 |
| 482 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM | 23.203 | 0,02 |
| 956 | Lincoln National Corp | 56.414 | 0,04 |
| 2.841 | Linde Plc | 604.849 | 0,44 |
| 1.295 | LKQ Corp | 46.231 | 0,03 |
| 1.236 | Lockheed Martin Corp | 481.274 | 0,35 |
| 1.176 | Loews Corp | 61.728 | 0,04 |
| 4.065 | Lowe's Cos Inc | 486.824 | 0,35 |
| 592 | Lululemon Athletica Inc | 137.149 | 0,10 |
| 1.278 | Lyft Inc | 54.980 | 0,04 |
| 1.568 | LyondellBasell Industries NV | 148.145 | 0,11 |
| 675 | M&T Bank Corp | 114.581 | 0,08 |
| 3.694 | Marathon Oil Corp | 50.165 | 0,04 |
| 3.333 | Marathon Petroleum Corp | 200.813 | 0,14 |
| 73 | Markel Corp | 83.451 | 0,06 |
| 1.317 | Marriott International Inc/MD | 199.433 | 0,14 |
| 2.639 | Marsh & McLennan Cos Inc | 294.011 | 0,21 |
| 317 | Martin Marietta Materials Inc | 88.646 | 0,06 |
| 3.546 | Marvell Technology Group Ltd | 94.182 | 0,07 |
| 1.352 | Masco Corp | 64.882 | 0,05 |
| 4.660 | Mastercard Inc | 1.391.429 | 1,00 |
| 221 | Match Group Inc | 18.146 | 0,01 |
| 1.502 | Maxim Integrated Products Inc | 92.388 | 0,07 |
| 661 | McCormick & Co Inc/MD | 112.192 | 0,08 |
| 3.959 | McDonald's Corp | 782.338 | 0,56 |
| 980 | McKesson Corp | 135.554 | 0,10 |
| 7.044 | Medtronic Plc | 799.142 | 0,57 |
| 253 | MercadoLibre Inc | 144.701 | 0,10 |
| 13.475 | Merck & Co Inc | 1.225.551 | 0,88 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 3.865 | MetLife Inc | 196.999 | 0,14 |
| 131 | Mettler-Toledo International Inc | 103.920 | 0,07 |
| 2.120 | MGM Resorts International | 70.532 | 0,05 |
| 1.318 | Microchip Technology Inc | 138.021 | 0,10 |
| 5.738 | Micron Technology Inc | 308.590 | 0,22 |
| 39.588 | Microsoft Corp | 6.243.028 | 4,49 |
| 564 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | 74.369 | 0,05 |
| 240 | Middleby Corp/The | 26.285 | 0,02 |
| 268 | Mohawk Industries Inc | 36.550 | 0,03 |
| 1.061 | Molson Coors Beverage Co - Class B | 57.188 | 0,04 |
| 7.911 | Mondelez International Inc | 435.738 | 0,31 |
| 2.102 | Monster Beverage Corp | 133.582 | 0,10 |
| 932 | Moody's Corp | 221.266 | 0,16 |
| 6.819 | Morgan Stanley | 348.587 | 0,25 |
| 1.546 | Mosaic Co/The | 33.455 | 0,02 |
| 840 | Motorola Solutions Inc | 135.358 | 0,10 |
| 434 | MSCI Inc - Class A | 112.050 | 0,08 |
| 2.831 | Mylan NV | 56.903 | 0,04 |
| 631 | Nasdaq Inc | 67.580 | 0,05 |
| 1.684 | National Oilwell Varco Inc | 42.184 | 0,03 |
| 1.121 | NetApp Inc | 69.782 | 0,05 |
| 2.265 | Netflix Inc | 732.886 | 0,53 |
| 1.877 | Newell Brands Inc | 36.076 | 0,03 |
| 4.423 | Newmont Goldcorp Corp | 192.179 | 0,14 |
| 2.543 | NextEra Energy Inc | 615.813 | 0,44 |
| 1.563 | Nielsen Holdings Plc | 31.729 | 0,02 |
| 6.428 | NIKE Inc | 651.221 | 0,47 |
| 2.422 | NiSource Inc | 67.428 | 0,05 |
| 2.593 | Noble Energy Inc | 64.410 | 0,05 |
| 1.421 | Norfolk Southern Corp | 275.859 | 0,20 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.219 | Northern Trust Corp | 129.507 | 0,09 |
| 780 | Northrop Grumman Corp | 268.297 | 0,19 |
| 2.690 | NortonLifeLock Inc | 68.649 | 0,05 |
| 963 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | 56.249 | 0,04 |
| 1.565 | Nucor Corp | 88.078 | 0,06 |
| 3.080 | NVIDIA Corp | 724.724 | 0,52 |
| 18 | NVR Inc | 68.551 | 0,05 |
| 4.749 | Occidental Petroleum Corp | 195.706 | 0,14 |
| 975 | Omnicom Group Inc | 78.994 | 0,06 |
| 2.098 | ONEOK Inc | 158.756 | 0,11 |
| 11.314 | Oracle Corp | 599.416 | 0,43 |
| 400 | O'Reilly Automotive Inc | 175.304 | 0,13 |
| 1.756 | PACCAR Inc | 138.900 | 0,10 |
| 422 | Packaging Corp of America | 47.260 | 0,03 |
| 477 | Palo Alto Networks Inc | 110.306 | 0,08 |
| 683 | Parker-Hannifin Corp | 140.575 | 0,10 |
| 1.683 | Paychex Inc | 143.156 | 0,10 |
| 6.217 | PayPal Holdings Inc | 672.493 | 0,48 |
| 7.239 | PepsiCo Inc | 989.354 | 0,71 |
| 556 | Perrigo Co Plc | 28.723 | 0,02 |
| 29.151 | Pfizer Inc | 1.142.136 | 0,82 |
| 8.158 | Philip Morris International Inc | 694.164 | 0,50 |
| 2.265 | Phillips 66 | 252.344 | 0,18 |
| 688 | Pinnacle West Capital Corp | 61.872 | 0,04 |
| 889 | Pioneer Natural Resources Co | 134.568 | 0,10 |
| 2.192 | PNC Financial Services Group Inc/The | 349.909 | 0,25 |
| 1.232 | PPG Industries Inc | 164.460 | 0,12 |
| 3.956 | PPL Corp | 141.941 | 0,10 |
| 1.575 | Principal Financial Group Inc | 86.625 | 0,06 |
| 12.953 | Procter & Gamble Co/The | 1.617.830 | 1,16 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 2.995 | Progressive Corp/The | 216.808 | 0,16 |
| 3.268 | Prologis Inc (REIT) | 291.309 | 0,21 |
| 2.134 | Prudential Financial Inc | 200.041 | 0,14 |
| 2.689 | Public Service Enterprise Group Inc | 158.785 | 0,11 |
| 787 | Public Storage (REIT) | 167.600 | 0,12 |
| 1.114 | PulteGroup Inc | 43.223 | 0,03 |
| 330 | PVH Corp | 34.699 | 0,03 |
| 628 | Qorvo Inc | 72.992 | 0,05 |
| 6.346 | QUALCOMM Inc | 559.908 | 0,40 |
| 588 | Quest Diagnostics Inc | 62.793 | 0,05 |
| 558 | Raymond James Financial Inc | 49.919 | 0,04 |
| 1.430 | Raytheon Co | 314.228 | 0,23 |
| 1.718 | Realty Income Corp (REIT) | 126.496 | 0,09 |
| 1.054 | Regency Centers Corp (REIT) | 66.497 | 0,05 |
| 406 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 152.445 | 0,11 |
| 4.564 | Regions Financial Corp | 78.318 | 0,06 |
| 272 | Reinsurance Group of America Inc - Class A | 44.352 | 0,03 |
| 1.103 | Republic Services Inc - Class A | 98.862 | 0,07 |
| 712 | ResMed Inc | 110.339 | 0,08 |
| 603 | Rockwell Automation Inc | 122.210 | 0,09 |
| 715 | Rollins Inc | 23.709 | 0,02 |
| 519 | Roper Technologies Inc | 183.845 | 0,13 |
| 1.837 | Ross Stores Inc | 213.864 | 0,15 |
| 922 | Royal Caribbean Cruises Ltd | 123.096 | 0,09 |
| 1.294 | S&P Global Inc | 353.327 | 0,25 |
| 4.456 | salesforce.com Inc | 724.724 | 0,52 |
| 578 | SBA Communications Corp (REIT) - Class A | 139.292 | 0,10 |
| 7.272 | Schlumberger Ltd | 292.334 | 0,21 |
| 1.137 | Seagate Technology Plc | 67.651 | 0,05 |
| 684 | Sealed Air Corp | 27.244 | 0,02 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-----------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 630 | Seattle Genetics Inc | 71.984 | 0,05 |
| 617 | SEI Investments Co | 40.401 | 0,03 |
| 1.426 | Sempra Energy | 216.010 | 0,16 |
| 993 | ServiceNow Inc | 280.344 | 0,20 |
| 437 | Sherwin-Williams Co/The | 255.007 | 0,18 |
| 226 | Signature Bank/New York NY | 30.874 | 0,02 |
| 1.513 | Simon Property Group Inc (REIT) | 225.376 | 0,16 |
| 6.838 | Sirius XM Holdings Inc | 48.892 | 0,04 |
| 904 | Skyworks Solutions Inc | 109.276 | 0,08 |
| 373 | SL Green Realty Corp (REIT) | 34.271 | 0,02 |
| 5.176 | Snap Inc | 84.524 | 0,06 |
| 243 | Snap-on Inc | 41.164 | 0,03 |
| 5.504 | Southern Co/The (Units) | 350.605 | 0,25 |
| 2.658 | Southwest Airlines Co | 143.479 | 0,10 |
| 812 | Splunk Inc | 121.613 | 0,09 |
| 589 | Spotify Technology SA | 88.085 | 0,06 |
| 2.760 | Sprint Corp | 14.380 | 0,01 |
| 1.765 | Square Inc | 110.418 | 0,08 |
| 1.319 | SS&C Technologies Holdings Inc | 80.987 | 0,06 |
| 903 | Stanley Black & Decker Inc | 149.663 | 0,11 |
| 6.079 | Starbucks Corp | 534.466 | 0,38 |
| 2.026 | State Street Corp | 160.257 | 0,12 |
| 944 | Steel Dynamics Inc | 32.134 | 0,02 |
| 1.718 | Stryker Corp | 360.677 | 0,26 |
| 238 | SVB Financial Group | 59.748 | 0,04 |
| 3.231 | Synchrony Financial | 116.348 | 0,08 |
| 769 | Synopsys Inc | 107.045 | 0,08 |
| 2.433 | Sysco Corp | 208.119 | 0,15 |
| 1.281 | T Rowe Price Group Inc | 156.077 | 0,11 |
| 606 | Take-Two Interactive Software Inc | 74.193 | 0,05 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.278 | Tapestry Inc | 34.468 | 0,02 |
| 985 | Targa Resources Corp | 40.218 | 0,03 |
| 2.683 | Target Corp | 343.987 | 0,25 |
| 1.271 | TD Ameritrade Holding Corp | 63.169 | 0,05 |
| 1.737 | TE Connectivity Ltd | 166.474 | 0,12 |
| 236 | Teleflex Inc | 88.840 | 0,06 |
| 735 | Tesla Inc | 307.473 | 0,22 |
| 4.925 | Texas Instruments Inc | 631.828 | 0,45 |
| 1.337 | Textron Inc | 59.630 | 0,04 |
| 2.131 | Thermo Fisher Scientific Inc | 692.298 | 0,50 |
| 610 | Tiffany & Co | 81.526 | 0,06 |
| 5.982 | TJX Cos Inc/The | 365.261 | 0,26 |
| 1.670 | T-Mobile US Inc | 130.961 | 0,09 |
| 534 | Tractor Supply Co | 49.897 | 0,04 |
| 269 | TransDigm Group Inc | 150.640 | 0,11 |
| 1.199 | TransUnion | 102.646 | 0,07 |
| 1.357 | Travelers Cos Inc/The | 185.841 | 0,13 |
| 1.105 | Trimble Inc | 46.067 | 0,03 |
| 7.134 | Truist Financial Corp | 401.787 | 0,29 |
| 570 | Twilio Inc - Class A | 56.020 | 0,04 |
| 3.820 | Twitter Inc | 122.431 | 0,09 |
| 1.522 | Tyson Foods Inc - Class A | 138.563 | 0,10 |
| 1.120 | Uber Technologies Inc | 33.309 | 0,02 |
| 1.142 | UDR Inc (REIT) | 53.331 | 0,04 |
| 2.094 | UGI Corp | 94.565 | 0,07 |
| 311 | Ulta Beauty Inc | 78.727 | 0,06 |
| 2.347 | Under Armour Inc | 45.015 | 0,03 |
| 3.739 | Union Pacific Corp | 675.974 | 0,49 |
| 1.292 | United Airlines Holdings Inc | 113.812 | 0,08 |
| 3.719 | United Parcel Service Inc - Class B | 435.346 | 0,31 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 360 | United Rentals Inc | 60.037 | 0,04 |
| 4.534 | United Technologies Corp | 679.012 | 0,49 |
| 4.958 | UnitedHealth Group Inc | 1.457.553 | 1,05 |
| 362 | Universal Health Services Inc | 51.933 | 0,04 |
| 7.671 | US Bancorp | 454.814 | 0,33 |
| 176 | Vail Resorts Inc | 42.210 | 0,03 |
| 2.113 | Valero Energy Corp | 197.882 | 0,14 |
| 498 | Varian Medical Systems Inc | 70.721 | 0,05 |
| 724 | Veeva Systems Inc - Class A | 101.838 | 0,07 |
| 1.883 | Ventas Inc (REIT) | 108.724 | 0,08 |
| 5.629 | VEREIT Inc (REIT) | 52.012 | 0,04 |
| 565 | VeriSign Inc | 108.864 | 0,08 |
| 829 | Verisk Analytics Inc - Class A | 123.803 | 0,09 |
| 21.704 | Verizon Communications Inc | 1.332.626 | 0,96 |
| 1.319 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 288.795 | 0,21 |
| 1.711 | VF Corp | 170.518 | 0,12 |
| 2.929 | ViacomCBS Inc - Class B | 122.930 | 0,09 |
| 9.045 | Visa Inc - Class A | 1.699.555 | 1,22 |
| 421 | VMware Inc | 63.904 | 0,05 |
| 1.092 | Vornado Realty Trust (REIT) | 72.618 | 0,05 |
| 840 | Vulcan Materials Co | 120.952 | 0,09 |
| 3.896 | Walgreens Boots Alliance Inc | 229.708 | 0,17 |
| 7.289 | Walmart Inc | 866.225 | 0,62 |
| 9.470 | Walt Disney Co/The | 1.369.646 | 0,99 |
| 2.247 | Waste Management Inc | 256.068 | 0,18 |
| 319 | Waters Corp | 74.534 | 0,05 |
| 1.465 | WEC Energy Group Inc | 135.117 | 0,10 |
| 286 | WellCare Health Plans Inc | 94.440 | 0,07 |
| 2.032 | Welltower Inc (REIT) | 166.177 | 0,12 |
| 1.609 | Western Digital Corp | 102.123 | 0,07 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 2.323 | Western Union Co/The | 62.210 | 0,04 |
| 1.169 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | 90.948 | 0,07 |
| 322 | Westlake Chemical Corp | 22.588 | 0,02 |
| 1.136 | Westrock Co | 48.746 | 0,04 |
| 3.843 | Weyerhaeuser Co (REIT) | 116.059 | 0,08 |
| 283 | Whirlpool Corp | 41.751 | 0,03 |
| 6.446 | Williams Cos Inc/The | 152.899 | 0,11 |
| 677 | Willis Towers Watson Plc | 136.713 | 0,10 |
| 833 | Workday Inc - Class A | 136.987 | 0,10 |
| 1.413 | WP Carey Inc (REIT) | 113.097 | 0,08 |
| 852 | WR Berkley Corp | 58.873 | 0,04 |
| 250 | WW Grainger Inc | 84.630 | 0,06 |
| 502 | Wynn Resorts Ltd | 69.713 | 0,05 |
| 2.565 | Xcel Energy Inc | 162.852 | 0,12 |
| 1.312 | Xilinx Inc | 128.274 | 0,09 |
| 1.002 | Xylem Inc/NY | 78.948 | 0,06 |
| 1.607 | Yum China Holdings Inc | 77.152 | 0,06 |
| 1.549 | Yum! Brands Inc | 156.031 | 0,11 |
| 901 | Zayo Group Holdings Inc | 31.220 | 0,02 |
| 1.045 | Zimmer Biomet Holdings Inc | 156.416 | 0,11 |
| 813 | Zions Bancorp NA | 42.211 | 0,03 |
| 2.462 | Zoetis Inc | 325.846 | 0,23 |
| 221 | Zoom Video Communications Inc | 15.037 | 0,01 |
| Stammaktien insgesamt | | 138.835.416 | 99,84 |

L&G US Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Gesamtanlagen | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| Stammaktien | 138.835.416 | 99,84 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 219.936 | 0,16 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 139.055.352 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | % des Gesamt- vermö- gens |
|--|------------------------------------|
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | 99,84 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0,16 |
| | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | |

L&G UK Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert £ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,26 %) | | | |
| 4.980 | 3i Group Plc | 54.680 | 0,55 |
| 1.009 | Admiral Group Plc | 23.298 | 0,23 |
| 6.705 | Anglo American Plc | 145.700 | 1,46 |
| 1.794 | Antofagasta Plc | 16.447 | 0,17 |
| 2.509 | Ashtead Group Plc | 60.567 | 0,61 |
| 1.846 | Associated British Foods Plc | 47.959 | 0,48 |
| 6.935 | AstraZeneca Plc | 527.545 | 5,29 |
| 4.667 | Auto Trader Group Plc '144A' | 27.750 | 0,28 |
| 415 | AVEVA Group Plc | 19.322 | 0,19 |
| 20.219 | Aviva Plc | 84.657 | 0,85 |
| 16.564 | BAE Systems Plc | 93.553 | 0,94 |
| 88.908 | Barclays Plc | 159.714 | 1,60 |
| 5.261 | Barratt Developments Plc | 39.279 | 0,39 |
| 631 | Berkeley Group Holdings Plc | 30.660 | 0,31 |
| 11.186 | BHP Group Plc | 198.753 | 1,99 |
| 106.252 | BP Plc | 501.084 | 5,02 |
| 12.159 | British American Tobacco Plc | 392.918 | 3,94 |
| 4.764 | British Land Co Plc/The (REIT) | 30.432 | 0,31 |
| 43.910 | BT Group Plc | 84.500 | 0,85 |
| 1.739 | Bunzl Plc | 35.910 | 0,36 |
| 2.137 | Burberry Group Plc | 47.121 | 0,47 |
| 1.051 | Carnival Plc | 38.298 | 0,38 |
| 29.238 | Centrica Plc | 26.110 | 0,26 |
| 5.783 | CNH Industrial NV | 47.971 | 0,48 |
| 1.102 | Coca-Cola European Partners Plc | 42.325 | 0,42 |
| 8.206 | Compass Group Plc | 155.093 | 1,55 |
| 7.929 | ConvaTec Group Plc '144A' | 15.735 | 0,16 |
| 662 | Croda International Plc | 33.894 | 0,34 |
| 585 | DCC Plc | 38.282 | 0,38 |
| 12.816 | Diageo Plc | 410.176 | 4,11 |
| 5.894 | Direct Line Insurance Group Plc | 18.419 | 0,18 |

L&G UK Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert £ | % des Nettover- mögens |
|---|--|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,26 %) (Fortsetzung) | | | |
| 6.774 | DS Smith Plc | 26.026 | 0,26 |
| 1.369 | easyJet Plc | 19.501 | 0,20 |
| 2.570 | Evraz Plc | 10.383 | 0,10 |
| 4.736 | Experian Plc | 120.863 | 1,21 |
| 1.221 | Ferguson Plc | 83.638 | 0,84 |
| 5.634 | Fiat Chrysler Automobiles NV | 62.985 | 0,63 |
| 954 | Fresnillo Plc | 6.108 | 0,06 |
| 26.412 | GlaxoSmithKline Plc | 469.869 | 4,71 |
| 1.959 | Halma Plc | 41.452 | 0,42 |
| 1.389 | Hargreaves Lansdown Plc | 26.877 | 0,27 |
| 1.060 | Hikma Pharmaceuticals Plc | 21.105 | 0,21 |
| 109.777 | HSBC Holdings Plc | 649.770 | 6,51 |
| 4.942 | Imperial Brands Plc | 92.366 | 0,93 |
| 6.494 | Informa Plc | 55.654 | 0,56 |
| 879 | InterContinental Hotels Group Plc | 45.778 | 0,46 |
| 8.219 | International Consolidated Airlines Group SA | 51.369 | 0,52 |
| 836 | Intertek Group Plc | 48.923 | 0,49 |
| 5.255 | Investec Plc | 23.285 | 0,23 |
| 18.757 | ITV Plc | 28.323 | 0,28 |
| 10.920 | J Sainsbury Plc | 25.105 | 0,25 |
| 2.091 | JD Sports Fashion Plc | 17.510 | 0,18 |
| 1.006 | Johnson Matthey Plc | 30.140 | 0,30 |
| 11.045 | Kingfisher Plc | 23.968 | 0,24 |
| 3.562 | Land Securities Group Plc (REIT) | 35.264 | 0,35 |
| 30.835 | Legal & General Group Plc | 93.430 | 0,94 |
| 124 | Liberty Global Plc | 2.129 | 0,02 |
| 2.795 | Liberty Global Plc | 45.984 | 0,46 |
| 369.213 | Lloyds Banking Group Plc | 230.758 | 2,31 |
| 1.867 | London Stock Exchange Group Plc | 144.693 | 1,45 |
| 14.521 | M&G Plc | 34.444 | 0,35 |

L&G UK Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert £ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,26 %) (Fortsetzung) | | | |
| 10.280 | Marks & Spencer Group Plc | 21.948 | 0,22 |
| 24.924 | Melrose Industries Plc | 59.843 | 0,60 |
| 1.853 | Micro Focus International Plc | 19.712 | 0,20 |
| 2.543 | Mondi Plc | 45.075 | 0,45 |
| 17.742 | National Grid Plc | 167.538 | 1,68 |
| 677 | Next Plc | 47.512 | 0,48 |
| 658 | NMC Health Plc | 11.627 | 0,12 |
| 2.471 | Ocado Group Plc | 31.604 | 0,32 |
| 4.038 | Pearson Plc | 25.722 | 0,26 |
| 1.630 | Persimmon Plc | 43.928 | 0,44 |
| 13.904 | Prudential Plc | 201.469 | 2,02 |
| 3.738 | Reckitt Benckiser Group Plc | 229.102 | 2,30 |
| 10.250 | RELX Plc | 195.314 | 1,96 |
| 9.553 | Rentokil Initial Plc | 43.275 | 0,43 |
| 5.633 | Rio Tinto Plc | 253.654 | 2,54 |
| 695.587 | Rolls-Royce Group Plc - Preference | 696 | 0,01 |
| 9.934 | Rolls-Royce Holdings Plc | 67.869 | 0,68 |
| 456.964 | Rolls-Royce Holdings Plc - Preference | 457 | 0,00 |
| 23.581 | Royal Bank of Scotland Group Plc | 56.665 | 0,57 |
| 21.714 | Royal Dutch Shell Plc | 485.308 | 4,87 |
| 21.264 | Royal Dutch Shell Plc | 476.207 | 4,77 |
| 5.137 | RSA Insurance Group Plc | 29.055 | 0,29 |
| 5.361 | Sage Group Plc/The | 40.154 | 0,40 |
| 759 | Schroders Plc | 25.305 | 0,25 |
| 5.078 | Segro Plc (REIT) | 45.560 | 0,46 |
| 1.227 | Severn Trent Plc | 30.859 | 0,31 |
| 4.532 | Smith & Nephew Plc | 83.049 | 0,83 |
| 2.046 | Smiths Group Plc | 34.516 | 0,35 |
| 430 | Spirax-Sarco Engineering Plc | 38.227 | 0,38 |
| 5.107 | SSE Plc | 73.464 | 0,74 |

L&G UK Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert £ | % des Nettover- mögens |
|--|------------------------------|------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,26 %) (Fortsetzung) | | | |
| 2.715 | St James's Place Plc | 31.616 | 0,32 |
| 17.146 | Standard Chartered Plc | 122.148 | 1,22 |
| 13.347 | Standard Life Aberdeen Plc | 43.792 | 0,44 |
| 16.992 | Taylor Wimpey Plc | 32.863 | 0,33 |
| 2.211 | TechnipFMC Plc | 35.783 | 0,36 |
| 50.322 | Tesco Plc | 128.422 | 1,29 |
| 5.772 | Unilever Plc | 251.111 | 2,52 |
| 3.529 | United Utilities Group Plc | 33.293 | 0,33 |
| 141.835 | Vodafone Group Plc | 208.157 | 2,09 |
| 1.351 | Weir Group Plc/The | 20.393 | 0,20 |
| 871 | Whitbread Plc | 42.209 | 0,42 |
| 11.609 | Wm Morrison Supermarkets Plc | 23.195 | 0,23 |
| 6.501 | WPP Plc | 69.333 | 0,70 |
| Stammaktien insgesamt | | 9.942.881 | 99,67 |
| Gesamtanlagen | | | |
| Stammaktien | | 9.942.881 | 99,67 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | 32.886 | 0,33 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 9.975.767 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamtvermögens |
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | | 99,67 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | 0,33 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) | | | |
| 800 | ABC-Mart Inc | 54.769 | 0,05 |
| 8.200 | Acom Co Ltd | 37.501 | 0,03 |
| 6.000 | Advantest Corp | 340.097 | 0,29 |
| 21.400 | Aeon Co Ltd | 444.147 | 0,38 |
| 3.200 | AEON Financial Service Co Ltd | 50.853 | 0,04 |
| 2.800 | Aeon Mall Co Ltd | 49.932 | 0,04 |
| 6.500 | AGC Inc/Japan | 235.059 | 0,20 |
| 5.100 | Air Water Inc | 75.086 | 0,07 |
| 4.800 | Aisin Seiki Co Ltd | 179.765 | 0,16 |
| 17.300 | Ajinomoto Co Inc | 288.930 | 0,25 |
| 5.800 | Alfresa Holdings Corp | 118.909 | 0,10 |
| 5.900 | Alps Alpine Co Ltd | 135.291 | 0,12 |
| 10.100 | Amada Holdings Co Ltd | 116.172 | 0,10 |
| 9.200 | ANA Holdings Inc | 308.317 | 0,27 |
| 3.800 | Aozora Bank Ltd | 101.089 | 0,09 |
| 13.000 | Asahi Group Holdings Ltd | 596.080 | 0,52 |
| 5.500 | Asahi Intecc Co Ltd | 161.951 | 0,14 |
| 41.300 | Asahi Kasei Corp | 468.960 | 0,41 |
| 5.700 | Asics Corp | 95.249 | 0,08 |
| 58.900 | Astellas Pharma Inc | 1.013.508 | 0,88 |
| 6.100 | Bandai Namco Holdings Inc | 372.202 | 0,32 |
| 2.900 | Benesse Holdings Inc | 76.693 | 0,07 |
| 17.400 | Bridgestone Corp | 651.649 | 0,56 |
| 7.900 | Brother Industries Ltd | 165.088 | 0,14 |
| 2.700 | Calbee Inc | 88.323 | 0,08 |
| 32.300 | Canon Inc | 887.637 | 0,77 |
| 6.600 | Casio Computer Co Ltd | 133.063 | 0,12 |
| 5.200 | Central Japan Railway Co | 1.052.680 | 0,91 |
| 20.100 | Chiba Bank Ltd/The | 117.077 | 0,10 |
| 22.000 | Chubu Electric Power Co Inc | 312.059 | 0,27 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 6.600 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | 612.174 | 0,53 |
| 9.700 | Chugoku Electric Power Co Inc/The | 127.637 | 0,11 |
| 3.700 | Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc | 95.024 | 0,08 |
| 35.400 | Concordia Financial Group Ltd | 147.235 | 0,13 |
| 300 | Cosmos Pharmaceutical Corp | 62.277 | 0,05 |
| 3.900 | Credit Saison Co Ltd | 68.221 | 0,06 |
| 2.800 | CyberAgent Inc | 98.293 | 0,09 |
| 7.700 | Dai Nippon Printing Co Ltd | 209.726 | 0,18 |
| 8.400 | Daicel Corp | 81.082 | 0,07 |
| 3.600 | Daifuku Co Ltd | 220.621 | 0,19 |
| 33.600 | Dai-ichi Life Holdings Inc | 561.623 | 0,49 |
| 19.100 | Daiichi Sankyo Co Ltd | 1.270.345 | 1,10 |
| 8.100 | Daikin Industries Ltd | 1.151.552 | 1,00 |
| 2.000 | Daito Trust Construction Co Ltd | 248.079 | 0,21 |
| 18.800 | Daiwa House Industry Co Ltd | 586.446 | 0,51 |
| 56 | Daiwa House REIT Investment Corp (REIT) | 146.138 | 0,13 |
| 50.400 | Daiwa Securities Group Inc | 256.464 | 0,22 |
| 3.000 | DeNA Co Ltd | 48.447 | 0,04 |
| 13.600 | Denso Corp | 621.464 | 0,54 |
| 6.400 | Dentsu Group Inc | 222.314 | 0,19 |
| 2.700 | DIC Corp | 75.404 | 0,07 |
| 900 | Disco Corp | 214.493 | 0,19 |
| 10.700 | East Japan Railway Co | 970.606 | 0,84 |
| 2.700 | Ebara Corp | 82.609 | 0,07 |
| 8.300 | Eisai Co Ltd | 626.576 | 0,54 |
| 5.100 | Electric Power Development Co Ltd | 124.221 | 0,11 |
| 1.000 | Ezaki Glico Co Ltd | 44.766 | 0,04 |
| 7.500 | FamilyMart Co Ltd | 181.159 | 0,16 |
| 5.900 | FANUC Corp | 1.103.722 | 0,96 |
| 1.700 | Fast Retailing Co Ltd | 1.016.793 | 0,88 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 3.800 | Fuji Electric Co Ltd | 116.963 | 0,10 |
| 6.000 | Fuji Media Holdings Inc | 85.907 | 0,07 |
| 12.000 | FUJIFILM Holdings Corp | 577.502 | 0,50 |
| 6.000 | Fujitsu Ltd | 567.012 | 0,49 |
| 6.200 | Fukuoka Financial Group Inc | 120.092 | 0,10 |
| 106 | GLP J-Reit (REIT) | 131.579 | 0,11 |
| 1.200 | GMO Payment Gateway Inc | 82.595 | 0,07 |
| 6.800 | Hakuhodo DY Holdings Inc | 110.627 | 0,10 |
| 4.000 | Hamamatsu Photonics KK | 165.447 | 0,14 |
| 6.900 | Hankyu Hanshin Holdings Inc | 297.143 | 0,26 |
| 1.000 | Harmonic Drive Systems Inc | 48.493 | 0,04 |
| 8.600 | Haseko Corp | 116.408 | 0,10 |
| 600 | Hikari Tsushin Inc | 151.442 | 0,13 |
| 8.000 | Hino Motors Ltd | 85.539 | 0,07 |
| 900 | Hirose Electric Co Ltd | 116.190 | 0,10 |
| 1.700 | Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc | 83.690 | 0,07 |
| 2.800 | Hitachi Chemical Co Ltd | 117.874 | 0,10 |
| 3.000 | Hitachi Construction Machinery Co Ltd | 90.683 | 0,08 |
| 1.900 | Hitachi High-Technologies Corp | 135.321 | 0,12 |
| 29.000 | Hitachi Ltd | 1.234.451 | 1,07 |
| 5.200 | Hitachi Metals Ltd | 77.181 | 0,07 |
| 50.700 | Honda Motor Co Ltd | 1.445.772 | 1,25 |
| 1.500 | Hoshizaki Corp | 134.437 | 0,12 |
| 11.600 | Hoya Corp | 1.115.436 | 0,97 |
| 12.700 | Hulic Co Ltd | 153.791 | 0,13 |
| 6.640 | Idemitsu Kosan Co Ltd | 185.132 | 0,16 |
| 4.300 | IHI Corp | 101.847 | 0,09 |
| 3.700 | Iida Group Holdings Co Ltd | 65.335 | 0,06 |
| 31.400 | Inpex Corp | 328.374 | 0,28 |
| 10.700 | Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | 96.883 | 0,08 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 16.800 | Isuzu Motors Ltd | 200.812 | 0,17 |
| 1.400 | Ito En Ltd | 70.596 | 0,06 |
| 43.900 | ITOCHU Corp | 1.023.828 | 0,89 |
| 2.800 | Itochu Techno-Solutions Corp | 79.227 | 0,07 |
| 1.200 | Izumi Co Ltd | 43.451 | 0,04 |
| 8.400 | J Front Retailing Co Ltd | 118.261 | 0,10 |
| 10.500 | Japan Airlines Co Ltd | 328.212 | 0,28 |
| 16.500 | Japan Exchange Group Inc | 293.030 | 0,25 |
| 44.700 | Japan Post Holdings Co Ltd | 422.012 | 0,37 |
| 6.000 | Japan Post Insurance Co Ltd | 102.802 | 0,09 |
| 83 | Japan Retail Fund Investment Corp (REIT) | 178.182 | 0,15 |
| 34.900 | Japan Tobacco Inc | 781.175 | 0,68 |
| 16.200 | JFE Holdings Inc | 210.335 | 0,18 |
| 6.600 | JGC Holdings Corp | 106.584 | 0,09 |
| 6.300 | JSR Corp | 116.638 | 0,10 |
| 6.800 | JTEKT Corp | 81.406 | 0,07 |
| 98.100 | JXTG Holdings Inc | 449.450 | 0,39 |
| 13.500 | Kajima Corp | 181.118 | 0,16 |
| 3.800 | Kakaku.com Inc | 97.662 | 0,08 |
| 22.400 | Kansai Electric Power Co Inc/The | 260.638 | 0,23 |
| 6.700 | Kansai Paint Co Ltd | 165.042 | 0,14 |
| 14.500 | Kao Corp | 1.204.163 | 1,04 |
| 4.400 | Kawasaki Heavy Industries Ltd | 97.494 | 0,08 |
| 50.300 | KDDI Corp | 1.505.644 | 1,30 |
| 3.200 | Keihan Holdings Co Ltd | 156.062 | 0,14 |
| 7.200 | Keikyu Corp | 139.793 | 0,12 |
| 3.200 | Keio Corp | 194.635 | 0,17 |
| 4.700 | Keisei Electric Railway Co Ltd | 183.372 | 0,16 |
| 3.500 | Kewpie Corp | 79.002 | 0,07 |
| 5.500 | Keyence Corp | 1.947.964 | 1,69 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|----------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 4.500 | Kikkoman Corp | 222.360 | 0,19 |
| 5.900 | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | 321.399 | 0,28 |
| 26.400 | Kirin Holdings Co Ltd | 580.593 | 0,50 |
| 1.400 | Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd | 119.420 | 0,10 |
| 3.500 | Koito Manufacturing Co Ltd | 164.251 | 0,14 |
| 28.800 | Komatsu Ltd | 700.157 | 0,61 |
| 2.900 | Konami Holdings Corp | 119.682 | 0,10 |
| 14.900 | Konica Minolta Inc | 97.757 | 0,08 |
| 1.000 | Kose Corp | 147.228 | 0,13 |
| 35.600 | Kubota Corp | 565.407 | 0,49 |
| 10.900 | Kuraray Co Ltd | 133.498 | 0,12 |
| 10.000 | Kyocera Corp | 688.291 | 0,60 |
| 8.500 | Kyowa Kirin Co Ltd | 201.247 | 0,17 |
| 13.900 | Kyushu Electric Power Co Inc | 120.870 | 0,10 |
| 4.900 | Kyushu Railway Co | 164.573 | 0,14 |
| 1.400 | Lawson Inc | 79.742 | 0,07 |
| 1.600 | LINE Corp | 78.767 | 0,07 |
| 8.100 | Lion Corp | 158.385 | 0,14 |
| 8.900 | LIXIL Group Corp | 154.701 | 0,13 |
| 13.600 | M3 Inc | 413.600 | 0,36 |
| 1.500 | Mabuchi Motor Co Ltd | 57.281 | 0,05 |
| 7.400 | Makita Corp | 259.434 | 0,22 |
| 51.000 | Marubeni Corp | 380.406 | 0,33 |
| 6.300 | Marui Group Co Ltd | 154.667 | 0,13 |
| 2.300 | Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd | 89.630 | 0,08 |
| 18.000 | Mazda Motor Corp | 155.362 | 0,13 |
| 1.900 | McDonald's Holdings Co Japan Ltd | 91.613 | 0,08 |
| 36.700 | Mebuki Financial Group Inc | 94.557 | 0,08 |
| 4.600 | Medipal Holdings Corp | 102.138 | 0,09 |
| 3.700 | MEIJI Holdings Co Ltd | 251.263 | 0,22 |

L&G Japan Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 2.000 | Mercari Inc | 41.132 | 0,04 |
| 12.600 | MINEBEA MITSUMI Inc | 264.000 | 0,23 |
| 7.900 | MISUMI Group Inc | 197.872 | 0,17 |
| 43.000 | Mitsubishi Chemical Holdings Corp | 323.464 | 0,28 |
| 42.300 | Mitsubishi Corp | 1.128.778 | 0,98 |
| 60.700 | Mitsubishi Electric Corp | 836.981 | 0,72 |
| 37.800 | Mitsubishi Estate Co Ltd | 726.782 | 0,63 |
| 5.500 | Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | 84.720 | 0,07 |
| 9.700 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | 379.163 | 0,33 |
| 3.300 | Mitsubishi Materials Corp | 90.399 | 0,08 |
| 7.600 | Mitsubishi Tanabe Pharma Corp | 140.426 | 0,12 |
| 351.900 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | 1.920.837 | 1,66 |
| 16.400 | Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd | 106.541 | 0,09 |
| 51.900 | Mitsui & Co Ltd | 929.352 | 0,80 |
| 5.800 | Mitsui Chemicals Inc | 143.032 | 0,12 |
| 27.700 | Mitsui Fudosan Co Ltd | 681.062 | 0,59 |
| 3.800 | Mitsui OSK Lines Ltd | 105.774 | 0,09 |
| 713.100 | Mizuho Financial Group Inc | 1.104.345 | 0,96 |
| 4.000 | MonotaRO Co Ltd | 107.587 | 0,09 |
| 13.900 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | 461.862 | 0,40 |
| 19.500 | Murata Manufacturing Co Ltd | 1.210.462 | 1,05 |
| 3.300 | Nabtesco Corp | 99.144 | 0,09 |
| 5.900 | Nagoya Railroad Co Ltd | 184.044 | 0,16 |
| 7.900 | NEC Corp | 328.576 | 0,28 |
| 14.500 | Nexon Co Ltd | 193.467 | 0,17 |
| 8.900 | NGK Insulators Ltd | 155.929 | 0,13 |
| 5.700 | NGK Spark Plug Co Ltd | 111.928 | 0,10 |
| 3.200 | NH Foods Ltd | 132.800 | 0,11 |
| 3.100 | Nichirei Corp | 72.740 | 0,06 |
| 7.900 | Nidec Corp | 1.090.770 | 0,94 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 3.900 | Nihon M&A Center Inc | 135.114 | 0,12 |
| 11.300 | Nikon Corp | 139.749 | 0,12 |
| 3.600 | Nintendo Co Ltd | 1.456.563 | 1,26 |
| 2.600 | Nippon Express Co Ltd | 153.596 | 0,13 |
| 5.500 | Nippon Paint Holdings Co Ltd | 285.438 | 0,25 |
| 60 | Nippon Prologis REIT Inc (REIT) | 152.602 | 0,13 |
| 1.700 | Nippon Shinyaku Co Ltd | 148.139 | 0,13 |
| 24.900 | Nippon Steel Corp | 378.970 | 0,33 |
| 70.000 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | 1.775.845 | 1,54 |
| 3.300 | Nippon Television Holdings Inc | 44.395 | 0,04 |
| 5.700 | Nippon Yusen KK | 103.903 | 0,09 |
| 4.000 | Nissan Chemical Corp | 169.128 | 0,15 |
| 71.900 | Nissan Motor Co Ltd | 420.847 | 0,36 |
| 7.000 | Nisshin Seifun Group Inc | 122.770 | 0,11 |
| 2.200 | Nissin Foods Holdings Co Ltd | 164.380 | 0,14 |
| 2.400 | Nitori Holdings Co Ltd | 380.400 | 0,33 |
| 4.900 | Nitto Denko Corp | 278.647 | 0,24 |
| 3.300 | NOK Corp | 49.830 | 0,04 |
| 101.100 | Nomura Holdings Inc | 524.129 | 0,45 |
| 3.400 | Nomura Real Estate Holdings Inc | 81.969 | 0,07 |
| 137 | Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT) | 233.975 | 0,20 |
| 11.200 | Nomura Research Institute Ltd | 240.953 | 0,21 |
| 13.300 | NSK Ltd | 127.401 | 0,11 |
| 20.300 | NTT Data Corp | 274.029 | 0,24 |
| 35.800 | NTT DOCOMO Inc | 1.000.786 | 0,87 |
| 21.300 | Obayashi Corp | 238.529 | 0,21 |
| 1.900 | Obic Co Ltd | 258.054 | 0,22 |
| 10.500 | Odakyu Electric Railway Co Ltd | 246.473 | 0,21 |
| 28.000 | Oji Holdings Corp | 153.301 | 0,13 |
| 39.300 | Olympus Corp | 610.791 | 0,53 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 6.000 | Omron Corp | 354.451 | 0,31 |
| 11.800 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | 271.669 | 0,24 |
| 1.000 | Oracle Corp Japan | 91.557 | 0,08 |
| 6.200 | Oriental Land Co Ltd/Japan | 848.916 | 0,73 |
| 39.300 | ORIX Corp | 654.909 | 0,57 |
| 93 | Orix JREIT Inc (REIT) | 201.361 | 0,17 |
| 11.500 | Osaka Gas Co Ltd | 221.270 | 0,19 |
| 3.100 | Otsuka Corp | 124.799 | 0,11 |
| 12.200 | Otsuka Holdings Co Ltd | 548.172 | 0,47 |
| 12.800 | Pan Pacific International Holdings Corp | 213.304 | 0,18 |
| 69.600 | Panasonic Corp | 659.334 | 0,57 |
| 3.800 | Park24 Co Ltd | 93.326 | 0,08 |
| 3.100 | PeptiDream Inc | 159.742 | 0,14 |
| 5.200 | Persol Holdings Co Ltd | 98.138 | 0,08 |
| 3.600 | Pigeon Corp | 133.002 | 0,12 |
| 2.300 | Pola Orbis Holdings Inc | 55.323 | 0,05 |
| 26.700 | Rakuten Inc | 229.717 | 0,20 |
| 37.000 | Recruit Holdings Co Ltd | 1.395.564 | 1,21 |
| 25.000 | Renesas Electronics Corp | 172.533 | 0,15 |
| 71.200 | Resona Holdings Inc | 313.824 | 0,27 |
| 22.700 | Ricoh Co Ltd | 248.985 | 0,22 |
| 1.100 | Rinnai Corp | 86.542 | 0,07 |
| 2.700 | Rohm Co Ltd | 218.137 | 0,19 |
| 7.000 | Ryohin Keikaku Co Ltd | 164.638 | 0,14 |
| 12.000 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | 230.338 | 0,20 |
| 7.100 | SBI Holdings Inc/Japan | 151.244 | 0,13 |
| 1.300 | SCREEN Holdings Co Ltd | 89.597 | 0,08 |
| 1.400 | SCSK Corp | 73.043 | 0,06 |
| 6.600 | Secom Co Ltd | 593.772 | 0,51 |
| 5.500 | Sega Sammy Holdings Inc | 80.115 | 0,07 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 7.700 | Seibu Holdings Inc | 127.182 | 0,11 |
| 8.200 | Seiko Epson Corp | 124.877 | 0,11 |
| 13.000 | Sekisui Chemical Co Ltd | 227.762 | 0,20 |
| 19.100 | Sekisui House Ltd | 410.120 | 0,36 |
| 23.300 | Seven & i Holdings Co Ltd | 858.246 | 0,74 |
| 17.500 | Seven Bank Ltd | 57.649 | 0,05 |
| 4.700 | SG Holdings Co Ltd | 106.391 | 0,09 |
| 5.600 | Sharp Corp/Japan | 86.828 | 0,08 |
| 8.600 | Shimadzu Corp | 272.224 | 0,24 |
| 800 | Shimamura Co Ltd | 61.247 | 0,05 |
| 2.300 | Shimano Inc | 376.085 | 0,33 |
| 17.600 | Shimizu Corp | 180.737 | 0,16 |
| 12.100 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 1.342.774 | 1,16 |
| 6.600 | Shinsei Bank Ltd | 101.725 | 0,09 |
| 9.300 | Shionogi & Co Ltd | 579.094 | 0,50 |
| 12.000 | Shiseido Co Ltd | 859.296 | 0,74 |
| 13.900 | Shizuoka Bank Ltd/The | 104.626 | 0,09 |
| 4.100 | Showa Denko KK | 109.371 | 0,09 |
| 1.900 | SMC Corp/Japan | 879.236 | 0,76 |
| 49.800 | Softbank Corp | 668.811 | 0,58 |
| 46.500 | SoftBank Group Corp | 2.035.003 | 1,76 |
| 2.300 | Sohgo Security Services Co Ltd | 125.291 | 0,11 |
| 29.500 | Sojitz Corp | 95.551 | 0,08 |
| 10.400 | Sompo Holdings Inc | 411.502 | 0,36 |
| 38.100 | Sony Corp | 2.594.691 | 2,25 |
| 4.200 | Sony Financial Holdings Inc | 101.565 | 0,09 |
| 2.800 | Square Enix Holdings Co Ltd | 139.903 | 0,12 |
| 4.800 | Stanley Electric Co Ltd | 140.455 | 0,12 |
| 19.200 | Subaru Corp | 479.404 | 0,41 |
| 8.600 | SUMCO Corp | 144.501 | 0,13 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 53.100 | Sumitomo Chemical Co Ltd | 243.329 | 0,21 |
| 35.200 | Sumitomo Corp | 526.016 | 0,46 |
| 5.500 | Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd | 107.798 | 0,09 |
| 23.300 | Sumitomo Electric Industries Ltd | 354.190 | 0,31 |
| 4.100 | Sumitomo Heavy Industries Ltd | 118.086 | 0,10 |
| 7.300 | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | 238.060 | 0,21 |
| 38.900 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 1.445.394 | 1,25 |
| 8.900 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | 355.181 | 0,31 |
| 9.900 | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | 347.263 | 0,30 |
| 6.400 | Sumitomo Rubber Industries Ltd | 78.737 | 0,07 |
| 2.300 | Sundrug Co Ltd | 83.704 | 0,07 |
| 3.900 | Suntory Beverage & Food Ltd | 163.106 | 0,14 |
| 2.000 | Suzuken Co Ltd/Aichi Japan | 82.172 | 0,07 |
| 12.500 | Suzuki Motor Corp | 525.305 | 0,45 |
| 4.500 | Systemex Corp | 308.447 | 0,27 |
| 16.200 | T&D Holdings Inc | 207.950 | 0,18 |
| 3.200 | Taiheiyo Cement Corp | 94.668 | 0,08 |
| 5.900 | Taisei Corp | 246.749 | 0,21 |
| 1.200 | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd | 89.551 | 0,08 |
| 4.600 | Taiyo Nippon Sanso Corp | 102.772 | 0,09 |
| 3.900 | Takashimaya Co Ltd | 44.069 | 0,04 |
| 47.700 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | 1.901.416 | 1,65 |
| 4.000 | TDK Corp | 456.038 | 0,39 |
| 5.400 | Teijin Ltd | 101.615 | 0,09 |
| 22.100 | Terumo Corp | 790.048 | 0,68 |
| 3.700 | THK Co Ltd | 101.050 | 0,09 |
| 2.299 | TIS Inc | 136.025 | 0,12 |
| 6.100 | Tobu Railway Co Ltd | 221.997 | 0,19 |
| 3.300 | Toho Co Ltd/Tokyo | 138.012 | 0,12 |
| 3.100 | Toho Gas Co Ltd | 127.223 | 0,11 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 14.800 | Tohoku Electric Power Co Inc | 147.353 | 0,13 |
| 19.900 | Tokio Marine Holdings Inc | 1.120.479 | 0,97 |
| 3.200 | Tokyo Broadcasting System Holdings Inc | 54.945 | 0,05 |
| 1.600 | Tokyo Century Corp | 86.128 | 0,07 |
| 4.700 | Tokyo Electron Ltd | 1.034.713 | 0,90 |
| 13.300 | Tokyo Gas Co Ltd | 324.499 | 0,28 |
| 18.900 | Tokyu Corp | 351.130 | 0,30 |
| 17.100 | Tokyu Fudosan Holdings Corp | 118.799 | 0,10 |
| 7.700 | Toppan Printing Co Ltd | 160.200 | 0,14 |
| 48.300 | Toray Industries Inc | 329.378 | 0,29 |
| 9.300 | Tosoh Corp | 145.052 | 0,13 |
| 4.500 | TOTO Ltd | 192.132 | 0,17 |
| 4.500 | Toyo Seikan Group Holdings Ltd | 78.261 | 0,07 |
| 2.700 | Toyo Suisan Kaisha Ltd | 115.031 | 0,10 |
| 2.000 | Toyoda Gosei Co Ltd | 50.518 | 0,04 |
| 1.844 | Toyota Boshoku Corp | 29.949 | 0,03 |
| 4.900 | Toyota Industries Corp | 285.411 | 0,25 |
| 70.200 | Toyota Motor Corp | 4.982.955 | 4,31 |
| 7.300 | Toyota Tsusho Corp | 259.287 | 0,22 |
| 3.700 | Trend Micro Inc/Japan | 190.660 | 0,17 |
| 1.100 | Tsuruha Holdings Inc | 141.909 | 0,12 |
| 11.200 | Unicharm Corp | 381.320 | 0,33 |
| 85 | United Urban Investment Corp (REIT) | 159.245 | 0,14 |
| 6.700 | USS Co Ltd | 127.372 | 0,11 |
| 1.300 | Welcia Holdings Co Ltd | 83.138 | 0,07 |
| 5.700 | West Japan Railway Co | 495.180 | 0,43 |
| 502 | Workman Co Ltd | 47.070 | 0,04 |
| 3.800 | Yakult Honsha Co Ltd | 210.849 | 0,18 |
| 21.400 | Yamada Denki Co Ltd | 113.818 | 0,10 |
| 5.200 | Yamaha Corp | 290.922 | 0,25 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|----------------------------|--------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung) | | | |
| 8.200 | Yamaha Motor Co Ltd | 166.226 | 0,14 |
| 9.900 | Yamato Holdings Co Ltd | 170.079 | 0,15 |
| 4.500 | Yamazaki Baking Co Ltd | 80.704 | 0,07 |
| 8.000 | Yaskawa Electric Corp | 306.970 | 0,27 |
| 8.000 | Yokogawa Electric Corp | 142.001 | 0,12 |
| 3.500 | Yokohama Rubber Co Ltd/The | 68.631 | 0,06 |
| 83.400 | Z Holdings Corp | 353.783 | 0,31 |
| 6.000 | ZOZO Inc | 115.224 | 0,10 |
| Stammaktien insgesamt | | 115.361.098 | 99,85 |
| Gesamtanlagen | | | |
| Stammaktien | | 115.361.098 | 99,85 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | 173.098 | 0,15 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 115.534.196 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | |
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | | 99,84 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | 0,16 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) | | | |
| 446 | 3i Group Plc | 6.487 | 0,02 |
| 412 | 3M Co | 72.685 | 0,23 |
| 802 | a2 Milk Co Ltd | 8.127 | 0,03 |
| 4.627 | A2A SpA | 8.684 | 0,03 |
| 1.614 | ABB Ltd | 38.951 | 0,12 |
| 1.299 | Abbott Laboratories | 112.831 | 0,35 |
| 1.125 | AbbVie Inc | 99.608 | 0,31 |
| 17 | ABIOMED Inc | 2.900 | 0,01 |
| 196 | ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A' | 3.569 | 0,01 |
| 529 | Accenture Plc - Class A | 111.392 | 0,35 |
| 107 | Accor SA | 5.014 | 0,02 |
| 136 | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | 5.442 | 0,02 |
| 511 | Activision Blizzard Inc | 30.364 | 0,09 |
| 134 | adidas AG | 43.589 | 0,14 |
| 484 | Admiral Group Plc | 14.805 | 0,05 |
| 327 | Adobe Inc | 107.848 | 0,34 |
| 30 | Advance Auto Parts Inc | 4.805 | 0,01 |
| 726 | Advanced Micro Devices Inc | 33.294 | 0,10 |
| 200 | Advantest Corp | 11.337 | 0,04 |
| 8 | Adyen NV '144A' | 6.564 | 0,02 |
| 32 | Aena SME SA '144A' | 6.124 | 0,02 |
| 300 | Aeon Co Ltd | 6.226 | 0,02 |
| 24 | Aeroports de Paris | 4.744 | 0,01 |
| 489 | Aflac Inc | 25.868 | 0,08 |
| 200 | AGC Inc/Japan | 7.233 | 0,02 |
| 99 | Ageas | 5.854 | 0,02 |
| 274 | Agilent Technologies Inc | 23.375 | 0,07 |
| 387 | AGL Energy Ltd | 5.585 | 0,02 |
| 100 | Agnico Eagle Mines Ltd (Units) | 6.168 | 0,02 |
| 8.200 | AIA Group Ltd | 86.085 | 0,27 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 400 | Air Canada - Class B | 14.964 | 0,05 |
| 312 | Air Liquide SA | 44.197 | 0,14 |
| 166 | Air Products & Chemicals Inc | 39.008 | 0,12 |
| 399 | Airbus SE | 58.438 | 0,18 |
| 100 | Aisin Seiki Co Ltd | 3.745 | 0,01 |
| 300 | Ajinomoto Co Inc | 5.010 | 0,02 |
| 73 | Akamai Technologies Inc | 6.306 | 0,02 |
| 86 | Akzo Nobel NV | 8.750 | 0,03 |
| 78 | Alaska Air Group Inc | 5.285 | 0,02 |
| 47 | Albemarle Corp | 3.433 | 0,01 |
| 524 | Alcon Inc | 29.653 | 0,09 |
| 159 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | 25.691 | 0,08 |
| 175 | Alexion Pharmaceuticals Inc | 18.926 | 0,06 |
| 200 | Alfa Laval AB | 5.040 | 0,02 |
| 1.300 | Algonquin Power & Utilities Corp | 18.416 | 0,06 |
| 66 | Align Technology Inc | 18.417 | 0,06 |
| 800 | Alimentation Couche-Tard Inc - Class B | 25.424 | 0,08 |
| 8 | Alleghany Corp | 6.397 | 0,02 |
| 230 | Allergan Plc | 43.969 | 0,14 |
| 24 | Alliance Data Systems Corp | 2.693 | 0,01 |
| 116 | Alliant Energy Corp | 6.348 | 0,02 |
| 396 | Allianz SE | 97.079 | 0,30 |
| 220 | Allstate Corp/The | 24.739 | 0,08 |
| 196 | Ally Financial Inc | 5.990 | 0,02 |
| 280 | Alphabet Inc | 374.366 | 1,17 |
| 181 | Alphabet Inc - Class A | 242.430 | 0,76 |
| 737 | Altice USA Inc | 20.150 | 0,06 |
| 1.266 | Altria Group Inc | 63.186 | 0,20 |
| 352 | Amadeus IT Group SA | 28.764 | 0,09 |
| 267 | Amarin Corp Plc ADR | 5.724 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 328 | Amazon.com Inc | 606.092 | 1,89 |
| 1.784 | Arcor Plc | 19.339 | 0,06 |
| 79 | Amdocs Ltd | 5.703 | 0,02 |
| 267 | Ameren Corp | 20.506 | 0,06 |
| 158 | American Airlines Group Inc | 4.531 | 0,01 |
| 321 | American Electric Power Co Inc | 30.338 | 0,09 |
| 475 | American Express Co | 59.133 | 0,18 |
| 49 | American Financial Group Inc/OH | 5.373 | 0,02 |
| 598 | American International Group Inc | 30.695 | 0,10 |
| 395 | American Tower Corp (REIT) | 90.779 | 0,28 |
| 70 | American Water Works Co Inc | 8.600 | 0,03 |
| 155 | Ameriprise Financial Inc | 25.820 | 0,08 |
| 63 | AmerisourceBergen Corp - Class A | 5.356 | 0,02 |
| 93 | AMETEK Inc | 9.276 | 0,03 |
| 426 | Amgen Inc | 102.696 | 0,32 |
| 236 | Amphenol Corp - Class A | 25.542 | 0,08 |
| 200 | ANA Holdings Inc | 6.703 | 0,02 |
| 274 | Analog Devices Inc | 32.562 | 0,10 |
| 1.042 | Anglo American Plc | 29.996 | 0,09 |
| 699 | Anheuser-Busch InBev SA/NV | 57.049 | 0,18 |
| 509 | Annaly Capital Management Inc (REIT) | 4.795 | 0,01 |
| 33 | ANSYS Inc | 8.495 | 0,03 |
| 171 | Anthem Inc | 51.647 | 0,16 |
| 303 | AO Smith Corp | 14.435 | 0,04 |
| 155 | Aon Plc | 32.285 | 0,10 |
| 700 | Aozora Bank Ltd | 18.622 | 0,06 |
| 4 | AP Moller - Maersk A/S - Class B | 5.773 | 0,02 |
| 718 | APA Group | 5.602 | 0,02 |
| 149 | Apache Corp | 3.813 | 0,01 |
| 202 | Apollo Global Management Inc - Class A | 9.637 | 0,03 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 2.968 | Apple Inc | 871.553 | 2,72 |
| 721 | Applied Materials Inc | 44.010 | 0,14 |
| 220 | Aptiv Plc | 20.893 | 0,07 |
| 140 | Aramark | 6.076 | 0,02 |
| 653 | ArcelorMittal SA | 11.465 | 0,04 |
| 180 | Arch Capital Group Ltd | 7.720 | 0,02 |
| 411 | Archer-Daniels-Midland Co | 19.050 | 0,06 |
| 241 | Arconic Inc | 7.416 | 0,02 |
| 66 | Arista Networks Inc | 13.424 | 0,04 |
| 253 | Aristocrat Leisure Ltd | 5.988 | 0,02 |
| 71 | Arthur J Gallagher & Co | 6.761 | 0,02 |
| 200 | Asahi Group Holdings Ltd | 9.170 | 0,03 |
| 400 | Asahi Intecc Co Ltd | 11.778 | 0,04 |
| 500 | Asahi Kasei Corp | 5.677 | 0,02 |
| 205 | Ashtead Group Plc | 6.556 | 0,02 |
| 700 | Asics Corp | 11.697 | 0,04 |
| 283 | ASML Holding NV | 83.767 | 0,26 |
| 380 | Assa Abloy AB | 8.890 | 0,03 |
| 1.349 | Assicurazioni Generali SpA | 27.854 | 0,09 |
| 161 | Associated British Foods Plc | 5.541 | 0,02 |
| 1.900 | Astellas Pharma Inc | 32.694 | 0,10 |
| 1.162 | AstraZeneca Plc | 117.099 | 0,37 |
| 756 | ASX Ltd | 41.670 | 0,13 |
| 5.796 | AT&T Inc | 226.508 | 0,71 |
| 109 | Athene Holding Ltd - Class A | 5.126 | 0,02 |
| 248 | Atlantia SpA | 5.787 | 0,02 |
| 616 | Atlas Copco AB | 24.585 | 0,08 |
| 212 | Atlas Copco AB | 7.365 | 0,02 |
| 67 | Atlassian Corp Plc | 8.063 | 0,03 |
| 54 | Atmos Energy Corp | 6.040 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.041 | Auckland International Airport Ltd | 6.145 | 0,02 |
| 5.832 | Aurizon Holdings Ltd | 21.441 | 0,07 |
| 700 | Aurora Cannabis Inc (Units) | 1.506 | 0,00 |
| 2.181 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | 37.761 | 0,12 |
| 1.775 | Auto Trader Group Plc '144A' | 13.982 | 0,04 |
| 173 | Autodesk Inc | 31.739 | 0,10 |
| 59 | Autoliv Inc | 4.980 | 0,02 |
| 427 | Automatic Data Processing Inc | 72.803 | 0,23 |
| 20 | AutoZone Inc | 23.826 | 0,07 |
| 110 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | 23.067 | 0,07 |
| 245 | Avangrid Inc | 12.534 | 0,04 |
| 3.556 | Aviva Plc | 19.724 | 0,06 |
| 1.319 | AXA SA | 37.177 | 0,12 |
| 580 | Axalta Coating Systems Ltd | 17.632 | 0,05 |
| 2.777 | BAE Systems Plc | 20.778 | 0,06 |
| 186 | Baker Hughes Co - Class A | 4.767 | 0,01 |
| 133 | Ball Corp | 8.601 | 0,03 |
| 700 | Banca Mediolanum SpA | 6.958 | 0,02 |
| 4.676 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | 26.154 | 0,08 |
| 11.246 | Banco Santander SA | 47.085 | 0,15 |
| 100 | Bandai Namco Holdings Inc | 6.102 | 0,02 |
| 733 | Bank Hapoalim BM | 6.080 | 0,02 |
| 901 | Bank Leumi Le-Israel BM | 6.558 | 0,02 |
| 6.560 | Bank of America Corp | 231.043 | 0,72 |
| 1.600 | Bank of East Asia Ltd/The | 3.573 | 0,01 |
| 711 | Bank of Ireland Group Plc | 3.896 | 0,01 |
| 400 | Bank of Montreal | 31.044 | 0,10 |
| 561 | Bank of New York Mellon Corp/The | 28.235 | 0,09 |
| 700 | Bank of Nova Scotia/The | 39.596 | 0,12 |
| 1.516 | Bankinter SA | 11.115 | 0,03 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|----------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 24.030 | Barclays Plc | 57.186 | 0,18 |
| 715 | Barratt Developments Plc | 7.072 | 0,02 |
| 1.019 | Barrick Gold Corp | 18.954 | 0,06 |
| 648 | BASF SE | 48.988 | 0,15 |
| 340 | Baxter International Inc | 28.431 | 0,09 |
| 632 | Bayer AG | 51.652 | 0,16 |
| 905 | Bayerische Motoren Werke AG | 74.299 | 0,23 |
| 600 | BCE Inc | 27.836 | 0,09 |
| 172 | Becton Dickinson and Co | 46.779 | 0,15 |
| 48 | Beiersdorf AG | 5.746 | 0,02 |
| 911 | Berkshire Hathaway Inc - Class B | 206.341 | 0,64 |
| 88 | Best Buy Co Inc | 7.726 | 0,02 |
| 2.222 | BHP Group Ltd | 60.792 | 0,19 |
| 1.645 | BHP Group Plc | 38.720 | 0,12 |
| 141 | Biogen Inc | 41.839 | 0,13 |
| 338 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 28.578 | 0,09 |
| 75 | BlackRock Inc | 37.702 | 0,12 |
| 500 | Blackstone Group Inc/The | 27.970 | 0,09 |
| 492 | BlueScope Steel Ltd | 5.209 | 0,02 |
| 805 | BNP Paribas SA | 47.737 | 0,15 |
| 379 | Boeing Co/The | 123.463 | 0,39 |
| 436 | Boliden AB | 11.574 | 0,04 |
| 2.517 | Bollore SA | 10.990 | 0,03 |
| 2.000 | Bombardier Inc - Class B | 2.977 | 0,01 |
| 33 | Booking Holdings Inc | 67.773 | 0,21 |
| 127 | BorgWarner Inc | 5.509 | 0,02 |
| 154 | Boston Properties Inc (REIT) | 21.230 | 0,07 |
| 1.046 | Boston Scientific Corp | 47.300 | 0,15 |
| 132 | Bouygues SA | 5.613 | 0,02 |
| 21.681 | BP Plc | 135.453 | 0,42 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 660 | Brambles Ltd | 5.437 | 0,02 |
| 500 | Bridgestone Corp | 18.726 | 0,06 |
| 1.098 | Bristol-Myers Squibb Co | 70.481 | 0,22 |
| 1.510 | British American Tobacco Plc | 64.642 | 0,20 |
| 637 | British Land Co Plc/The (REIT) | 5.391 | 0,02 |
| 377 | Broadcom Inc | 119.140 | 0,37 |
| 43 | Broadridge Financial Solutions Inc | 5.312 | 0,02 |
| 500 | Brookfield Asset Management Inc - Class A | 28.930 | 0,09 |
| 210 | Brown-Forman Corp | 13.182 | 0,04 |
| 162 | Brown-Forman Corp | 10.951 | 0,03 |
| 6.391 | BT Group Plc | 16.293 | 0,05 |
| 81 | Bunge Ltd | 4.662 | 0,01 |
| 171 | Bunzl Plc | 4.678 | 0,01 |
| 213 | Burberry Group Plc | 6.222 | 0,02 |
| 361 | Buzzi Unicem SpA | 9.097 | 0,03 |
| 192 | Cabot Oil & Gas Corp | 3.343 | 0,01 |
| 111 | Cadence Design Systems Inc | 7.699 | 0,02 |
| 1.404 | CaixaBank SA | 4.410 | 0,01 |
| 133 | Campbell Soup Co | 6.573 | 0,02 |
| 500 | Canadian Apartment Properties REIT (Units) (REIT) | 20.440 | 0,06 |
| 300 | Canadian Imperial Bank of Commerce | 25.000 | 0,08 |
| 500 | Canadian National Railway Co | 45.295 | 0,14 |
| 1.000 | Canadian Natural Resources Ltd | 32.389 | 0,10 |
| 100 | Canadian Pacific Railway Ltd | 25.528 | 0,08 |
| 100 | Canadian Tire Corp Ltd | 10.777 | 0,03 |
| 900 | Canon Inc | 24.733 | 0,08 |
| 100 | Canopy Growth Corp | 2.106 | 0,01 |
| 145 | Capgemini SE | 17.725 | 0,06 |
| 368 | Capital One Financial Corp | 37.871 | 0,12 |
| 2.200 | CapitalLand Ltd | 6.136 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 111 | Cardinal Health Inc | 5.614 | 0,02 |
| 200 | Carlsberg A/S | 29.857 | 0,09 |
| 71 | CarMax Inc | 6.225 | 0,02 |
| 337 | Carnival Corp | 17.130 | 0,05 |
| 90 | Carnival Plc | 4.345 | 0,01 |
| 252 | Carrefour SA | 4.229 | 0,01 |
| 405 | Caterpillar Inc | 59.810 | 0,19 |
| 45 | Cboe Global Markets Inc | 5.400 | 0,02 |
| 129 | CBRE Group Inc - Class A | 7.906 | 0,02 |
| 100 | CCL Industries Inc - Class B | 4.266 | 0,01 |
| 64 | CDW Corp/DE | 9.142 | 0,03 |
| 49 | Celanese Corp - Class A | 6.033 | 0,02 |
| 350 | Cellnex Telecom SA '144A' | 15.074 | 0,05 |
| 600 | Cenovus Energy Inc | 6.108 | 0,02 |
| 352 | Centene Corp | 22.130 | 0,07 |
| 182 | CenterPoint Energy Inc | 4.963 | 0,02 |
| 100 | Central Japan Railway Co | 20.244 | 0,06 |
| 16.542 | Centrica Plc | 19.569 | 0,06 |
| 1.099 | CenturyLink Inc | 14.518 | 0,05 |
| 295 | Cerner Corp | 21.650 | 0,07 |
| 100 | CGI Inc | 8.380 | 0,03 |
| 57 | CH Robinson Worldwide Inc | 4.457 | 0,01 |
| 797 | Charles Schwab Corp/The | 37.905 | 0,12 |
| 121 | Charter Communications Inc | 58.695 | 0,18 |
| 53 | Check Point Software Technologies Ltd | 5.881 | 0,02 |
| 92 | Cheniere Energy Inc | 5.618 | 0,02 |
| 1.370 | Chevron Corp | 165.099 | 0,52 |
| 1.600 | China Gas Holdings Ltd | 5.996 | 0,02 |
| 31 | Chipotle Mexican Grill Inc - Class A | 25.950 | 0,08 |
| 48 | Chr Hansen Holding A/S | 3.817 | 0,01 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 257 | Chubb Ltd | 40.005 | 0,12 |
| 400 | Chubu Electric Power Co Inc | 5.674 | 0,02 |
| 100 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd | 9.275 | 0,03 |
| 100 | Church & Dwight Co Inc | 7.034 | 0,02 |
| 185 | Cie de Saint-Gobain | 7.580 | 0,02 |
| 434 | Cie Financiere Richemont SA | 34.088 | 0,11 |
| 133 | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | 16.288 | 0,05 |
| 257 | Cigna Corp | 52.554 | 0,16 |
| 63 | Cincinnati Financial Corp | 6.624 | 0,02 |
| 34 | Cintas Corp | 9.149 | 0,03 |
| 3.289 | Cisco Systems Inc | 157.740 | 0,49 |
| 1.634 | Citigroup Inc | 130.540 | 0,41 |
| 182 | Citizens Financial Group Inc | 7.391 | 0,02 |
| 48 | Citrix Systems Inc | 5.323 | 0,02 |
| 2.000 | CK Asset Holdings Ltd | 14.438 | 0,04 |
| 2.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | 23.839 | 0,07 |
| 133 | Clorox Co/The | 20.421 | 0,06 |
| 1.000 | CLP Holdings Ltd | 10.511 | 0,03 |
| 335 | CME Group Inc | 67.241 | 0,21 |
| 106 | CMS Energy Corp | 6.661 | 0,02 |
| 474 | CNH Industrial NV | 5.209 | 0,02 |
| 2.697 | Coca-Cola Co/The | 149.279 | 0,47 |
| 108 | Coca-Cola European Partners Plc | 5.495 | 0,02 |
| 40 | Cochlear Ltd | 6.319 | 0,02 |
| 394 | Cognizant Technology Solutions Corp | 24.436 | 0,08 |
| 449 | Coles Group Ltd | 4.684 | 0,01 |
| 564 | Colgate-Palmolive Co | 38.826 | 0,12 |
| 54 | Coloplast A/S | 6.704 | 0,02 |
| 4.027 | Comcast Corp | 181.094 | 0,57 |
| 62 | Comerica Inc | 4.448 | 0,01 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 510 | Commerzbank AG | 3.158 | 0,01 |
| 1.183 | Commonwealth Bank of Australia | 66.444 | 0,21 |
| 1.158 | Compass Group Plc | 28.994 | 0,09 |
| 347 | Computershare Ltd | 4.093 | 0,01 |
| 505 | Conagra Brands Inc | 17.291 | 0,05 |
| 178 | Concho Resources Inc | 15.587 | 0,05 |
| 1.100 | Concordia Financial Group Ltd | 4.575 | 0,01 |
| 810 | ConocoPhillips | 52.674 | 0,16 |
| 268 | Consolidated Edison Inc | 24.246 | 0,08 |
| 126 | Constellation Brands Inc - Class A | 23.909 | 0,07 |
| 42 | Continental AG | 5.434 | 0,02 |
| 20 | Cooper Cos Inc/The | 6.426 | 0,02 |
| 217 | Copart Inc | 19.734 | 0,06 |
| 617 | Corning Inc | 17.961 | 0,06 |
| 494 | Corteva Inc | 14.603 | 0,05 |
| 32 | CoStar Group Inc | 19.146 | 0,06 |
| 371 | Costco Wholesale Corp | 109.044 | 0,34 |
| 75 | Covestro AG '144A' | 3.490 | 0,01 |
| 516 | Credit Agricole SA | 7.486 | 0,02 |
| 2.225 | Credit Suisse Group AG | 30.111 | 0,09 |
| 723 | CRH Plc | 28.948 | 0,09 |
| 78 | Croda International Plc | 5.291 | 0,02 |
| 279 | Crown Castle International Corp (REIT) | 39.660 | 0,12 |
| 313 | CSL Ltd | 60.674 | 0,19 |
| 2.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | 4.769 | 0,01 |
| 511 | CSX Corp | 36.976 | 0,12 |
| 141 | Cummins Inc | 25.233 | 0,08 |
| 1.373 | CVS Health Corp | 102.000 | 0,32 |
| 100 | CyberAgent Inc | 3.510 | 0,01 |
| 200 | Dai Nippon Printing Co Ltd | 5.447 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 100 | Daifuku Co Ltd | 6.128 | 0,02 |
| 500 | Dai-ichi Life Holdings Inc | 8.357 | 0,03 |
| 400 | Daiichi Sankyo Co Ltd | 26.604 | 0,08 |
| 200 | Daikin Industries Ltd | 28.433 | 0,09 |
| 616 | Daimler AG | 34.137 | 0,11 |
| 100 | Daito Trust Construction Co Ltd | 12.404 | 0,04 |
| 300 | Daiwa House Industry Co Ltd | 9.358 | 0,03 |
| 900 | Daiwa Securities Group Inc | 4.580 | 0,01 |
| 467 | Danaher Corp | 71.675 | 0,22 |
| 395 | Danone SA | 32.766 | 0,10 |
| 273 | Danske Bank A/S | 4.421 | 0,01 |
| 47 | Darden Restaurants Inc | 5.123 | 0,02 |
| 103 | Dassault Systemes SE | 16.943 | 0,05 |
| 73 | DaVita Inc | 5.477 | 0,02 |
| 900 | DBS Group Holdings Ltd | 17.322 | 0,05 |
| 59 | DCC Plc | 5.115 | 0,02 |
| 233 | Deere & Co | 40.370 | 0,13 |
| 204 | Dell Technologies Inc | 10.484 | 0,03 |
| 505 | Delta Air Lines Inc | 29.532 | 0,09 |
| 200 | Denso Corp | 9.139 | 0,03 |
| 143 | DENTSPLY SIRONA Inc | 8.092 | 0,03 |
| 100 | Dentsu Group Inc | 3.474 | 0,01 |
| 758 | Deutsche Bank AG | 5.885 | 0,02 |
| 143 | Deutsche Boerse AG | 22.496 | 0,07 |
| 225 | Deutsche Lufthansa AG | 4.144 | 0,01 |
| 794 | Deutsche Post AG | 30.311 | 0,09 |
| 2.373 | Deutsche Telekom AG | 38.809 | 0,12 |
| 153 | Deutsche Wohnen SE | 6.255 | 0,02 |
| 188 | Devon Energy Corp | 4.882 | 0,02 |
| 717 | Dexus (Units) (REIT) | 5.897 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.513 | Diageo Plc | 64.149 | 0,20 |
| 255 | Diamondback Energy Inc | 23.679 | 0,07 |
| 167 | Digital Realty Trust Inc (REIT) | 19.997 | 0,06 |
| 4.112 | Direct Line Insurance Group Plc | 17.023 | 0,05 |
| 325 | Discover Financial Services | 27.567 | 0,09 |
| 559 | Discovery Inc | 18.302 | 0,06 |
| 161 | DISH Network Corp - Class A | 5.711 | 0,02 |
| 417 | DNB ASA | 7.783 | 0,02 |
| 205 | Dollar General Corp | 31.976 | 0,10 |
| 174 | Dollar Tree Inc | 16.365 | 0,05 |
| 200 | Dollarama Inc | 6.883 | 0,02 |
| 648 | Dominion Energy Inc | 53.667 | 0,17 |
| 19 | Domino's Pizza Inc | 5.582 | 0,02 |
| 59 | Dover Corp | 6.800 | 0,02 |
| 569 | Dow Inc | 31.141 | 0,10 |
| 134 | DR Horton Inc | 7.069 | 0,02 |
| 305 | DSV PANALPINA A/S | 35.178 | 0,11 |
| 72 | DTE Energy Co | 9.351 | 0,03 |
| 430 | Duke Energy Corp | 39.220 | 0,12 |
| 179 | Duke Realty Corp (REIT) | 6.206 | 0,02 |
| 494 | DuPont de Nemours Inc | 31.715 | 0,10 |
| 269 | DXC Technology Co | 10.112 | 0,03 |
| 100 | E*TRADE Financial Corp | 4.537 | 0,01 |
| 1.972 | E.ON SE | 21.082 | 0,07 |
| 200 | East Japan Railway Co | 18.142 | 0,06 |
| 451 | Eastman Chemical Co | 35.746 | 0,11 |
| 324 | Eaton Corp Plc | 30.689 | 0,10 |
| 730 | eBay Inc | 26.360 | 0,08 |
| 168 | Ecolab Inc | 32.422 | 0,10 |
| 260 | Edison International | 19.607 | 0,06 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.417 | EDP - Energias de Portugal SA | 6.146 | 0,02 |
| 153 | Edwards Lifesciences Corp | 35.693 | 0,11 |
| 300 | Eisai Co Ltd | 22.647 | 0,07 |
| 532 | Elanco Animal Health Inc | 15.667 | 0,05 |
| 299 | Electricite de France SA | 3.332 | 0,01 |
| 231 | Electrolux AB | 5.673 | 0,02 |
| 229 | Electronic Arts Inc | 24.620 | 0,08 |
| 622 | Eli Lilly & Co | 81.749 | 0,26 |
| 116 | Elisa Oyj | 6.413 | 0,02 |
| 206 | Emera Inc | 8.863 | 0,03 |
| 460 | Emerson Electric Co | 35.080 | 0,11 |
| 1.200 | Enbridge Inc | 47.778 | 0,15 |
| 600 | Encana Corp | 2.813 | 0,01 |
| 235 | Endesa SA | 6.275 | 0,02 |
| 5.114 | Enel SpA | 40.596 | 0,13 |
| 1.375 | Engie SA | 22.225 | 0,07 |
| 1.911 | Eni SpA | 29.700 | 0,09 |
| 67 | Entergy Corp | 8.027 | 0,02 |
| 423 | EOG Resources Inc | 35.430 | 0,11 |
| 603 | Epiroc AB | 7.153 | 0,02 |
| 48 | Equifax Inc | 6.726 | 0,02 |
| 63 | Equinix Inc (REIT) | 36.773 | 0,11 |
| 1.298 | Equinor ASA | 25.924 | 0,08 |
| 289 | Equity Residential (REIT) | 23.386 | 0,07 |
| 165 | Erste Group Bank AG | 6.216 | 0,02 |
| 23 | Essex Property Trust Inc (REIT) | 6.920 | 0,02 |
| 247 | EssilorLuxottica SA | 37.651 | 0,12 |
| 232 | Essity AB | 7.480 | 0,02 |
| 165 | Estee Lauder Cos Inc/The - Class A | 34.079 | 0,11 |
| 23 | Everest Re Group Ltd | 6.367 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 102 | Evergy Inc | 6.639 | 0,02 |
| 259 | Eversource Energy | 22.033 | 0,07 |
| 574 | Exelon Corp | 26.169 | 0,08 |
| 86 | EXOR NV | 6.669 | 0,02 |
| 43 | Expedia Group Inc | 4.650 | 0,01 |
| 74 | Expeditors International of Washington Inc | 5.773 | 0,02 |
| 876 | Experian Plc | 29.615 | 0,09 |
| 56 | Extra Space Storage Inc (REIT) | 5.915 | 0,02 |
| 3.000 | Exxon Mobil Corp | 209.340 | 0,65 |
| 28 | F5 Networks Inc | 3.910 | 0,01 |
| 1.854 | Facebook Inc - Class A | 380.534 | 1,19 |
| 100 | Fairfax Financial Holdings Ltd | 47.021 | 0,15 |
| 400 | FamilyMart Co Ltd | 9.662 | 0,03 |
| 100 | FANUC Corp | 18.707 | 0,06 |
| 100 | Fast Retailing Co Ltd | 59.811 | 0,19 |
| 218 | Fastenal Co | 8.055 | 0,03 |
| 301 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | 38.748 | 0,12 |
| 172 | FedEx Corp | 26.008 | 0,08 |
| 178 | Ferguson Plc | 16.153 | 0,05 |
| 45 | Ferrari NV | 7.471 | 0,02 |
| 252 | Ferrovial SA | 7.629 | 0,02 |
| 915 | Fiat Chrysler Automobiles NV | 13.551 | 0,04 |
| 152 | Fidelity National Financial Inc | 6.893 | 0,02 |
| 365 | Fidelity National Information Services Inc | 50.768 | 0,16 |
| 257 | Fifth Third Bancorp | 7.900 | 0,02 |
| 500 | First Quantum Minerals Ltd | 5.078 | 0,02 |
| 66 | First Republic Bank/CA | 7.752 | 0,02 |
| 481 | FirstEnergy Corp | 23.377 | 0,07 |
| 411 | Fiserv Inc | 47.524 | 0,15 |
| 546 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | 8.178 | 0,03 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 92 | FleetCor Technologies Inc | 26.470 | 0,08 |
| 56 | Flutter Entertainment Plc | 6.811 | 0,02 |
| 62 | FMC Corp | 6.189 | 0,02 |
| 2.759 | Ford Motor Co | 25.659 | 0,08 |
| 1.133 | Fortescue Metals Group Ltd | 8.514 | 0,03 |
| 67 | Fortinet Inc | 7.153 | 0,02 |
| 202 | Fortis Inc/Canada | 8.393 | 0,03 |
| 255 | Fortive Corp | 19.479 | 0,06 |
| 231 | Fortum Oyj | 5.704 | 0,02 |
| 387 | Fortune Brands Home & Security Inc | 25.287 | 0,08 |
| 140 | Fox Corp | 5.190 | 0,02 |
| 255 | Fox Corp | 9.282 | 0,03 |
| 100 | Franco-Nevada Corp | 10.341 | 0,03 |
| 162 | Franklin Resources Inc | 4.209 | 0,01 |
| 86 | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | 6.367 | 0,02 |
| 310 | Fresenius SE & Co KGaA | 17.461 | 0,05 |
| 200 | FUJIFILM Holdings Corp | 9.625 | 0,03 |
| 100 | Fujitsu Ltd | 9.450 | 0,03 |
| 51 | Galapagos NV | 10.676 | 0,03 |
| 1.000 | Galaxy Entertainment Group Ltd | 7.367 | 0,02 |
| 292 | Galp Energia SGPS SA | 4.884 | 0,02 |
| 180 | Gap Inc/The | 3.182 | 0,01 |
| 77 | Garmin Ltd | 7.512 | 0,02 |
| 36 | Gartner Inc | 5.548 | 0,02 |
| 14 | Geberit AG | 7.853 | 0,02 |
| 7.448 | Geely Automobile Holdings Ltd | 14.568 | 0,05 |
| 178 | General Dynamics Corp | 31.390 | 0,10 |
| 5.691 | General Electric Co | 63.512 | 0,20 |
| 426 | General Mills Inc | 22.817 | 0,07 |
| 838 | General Motors Co | 30.671 | 0,10 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 34 | Genmab A/S | 7.567 | 0,02 |
| 51 | Genuine Parts Co | 5.418 | 0,02 |
| 300 | George Weston Ltd | 23.834 | 0,07 |
| 200 | Gildan Activewear Inc | 5.921 | 0,02 |
| 841 | Gilead Sciences Inc | 54.648 | 0,17 |
| 7 | Givaudan SA | 21.910 | 0,07 |
| 3.307 | GlaxoSmithKline Plc | 77.937 | 0,24 |
| 8.958 | Glencore Plc | 27.929 | 0,09 |
| 338 | Global Payments Inc | 61.705 | 0,19 |
| 58 | Globe Life Inc | 6.105 | 0,02 |
| 226 | Goldman Sachs Group Inc/The | 51.964 | 0,16 |
| 695 | Goodman Group (REIT) | 6.532 | 0,02 |
| 1.363 | GPT Group/The (REIT) | 5.365 | 0,02 |
| 200 | Great-West Lifeco Inc | 5.130 | 0,02 |
| 194 | Grifols SA | 6.844 | 0,02 |
| 849 | Groupe Bruxelles Lambert SA | 89.542 | 0,28 |
| 1.100 | H&R Real Estate Investment Trust (Units) (REIT) | 17.899 | 0,06 |
| 38 | HAL Trust | 6.142 | 0,02 |
| 1.550 | Halliburton Co | 37.928 | 0,12 |
| 647 | Halma Plc | 18.137 | 0,06 |
| 300 | Hang Seng Bank Ltd | 6.199 | 0,02 |
| 200 | Hankyu Hanshin Holdings Inc | 8.613 | 0,03 |
| 37 | Hannover Rueck SE | 7.156 | 0,02 |
| 541 | Hargreaves Lansdown Plc | 13.868 | 0,04 |
| 129 | Hartford Financial Services Group Inc/The | 7.839 | 0,02 |
| 51 | Hasbro Inc | 5.386 | 0,02 |
| 210 | HCA Healthcare Inc | 31.040 | 0,10 |
| 130 | HD Supply Holdings Inc | 5.229 | 0,02 |
| 188 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | 6.480 | 0,02 |
| 73 | HeidelbergCement AG | 5.323 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 57 | Heineken Holding NV | 5.528 | 0,02 |
| 245 | Heineken NV | 26.104 | 0,08 |
| 2.200 | Henderson Land Development Co Ltd | 10.800 | 0,03 |
| 169 | Henkel AG & Co KGaA | 15.935 | 0,05 |
| 57 | Henkel AG & Co KGaA - Preference | 5.899 | 0,02 |
| 322 | Hennes & Mauritz AB | 6.552 | 0,02 |
| 59 | Henry Schein Inc | 3.936 | 0,01 |
| 21 | Hermes International | 15.704 | 0,05 |
| 52 | Hershey Co/The | 7.643 | 0,02 |
| 111 | Hess Corp | 7.416 | 0,02 |
| 1.207 | Hewlett Packard Enterprise Co | 19.143 | 0,06 |
| 104 | Hexagon AB | 5.833 | 0,02 |
| 298 | Hilton Worldwide Holdings Inc | 33.051 | 0,10 |
| 800 | Hitachi Ltd | 34.054 | 0,11 |
| 125 | Hologic Inc | 6.526 | 0,02 |
| 843 | Home Depot Inc/The | 184.094 | 0,58 |
| 1.100 | Honda Motor Co Ltd | 31.368 | 0,10 |
| 572 | Honeywell International Inc | 101.244 | 0,32 |
| 6.600 | Hong Kong & China Gas Co Ltd | 12.892 | 0,04 |
| 1.000 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 32.470 | 0,10 |
| 800 | Hongkong Land Holdings Ltd | 4.600 | 0,01 |
| 113 | Hormel Foods Corp | 5.097 | 0,02 |
| 262 | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | 4.860 | 0,02 |
| 200 | Hoya Corp | 19.232 | 0,06 |
| 1.221 | HP Inc | 25.092 | 0,08 |
| 16.197 | HSBC Holdings Plc | 127.004 | 0,40 |
| 105 | Humana Inc | 38.485 | 0,12 |
| 404 | Huntington Bancshares Inc/OH | 6.092 | 0,02 |
| 22 | Huntington Ingalls Industries Inc | 5.519 | 0,02 |
| 1.300 | Hydro One Ltd '144A' | 25.143 | 0,08 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 32 | IAC/InterActiveCorp | 7.972 | 0,02 |
| 4.231 | Iberdrola SA | 43.598 | 0,14 |
| 100 | Idemitsu Kosan Co Ltd | 2.788 | 0,01 |
| 91 | IDEXX Laboratories Inc | 23.763 | 0,07 |
| 382 | IHS Markit Ltd | 28.784 | 0,09 |
| 202 | Illinois Tool Works Inc | 36.285 | 0,11 |
| 111 | Illumina Inc | 36.823 | 0,11 |
| 750 | Imperial Brands Plc | 18.570 | 0,06 |
| 200 | Imperial Oil Ltd | 5.298 | 0,02 |
| 73 | Incyte Corp | 6.374 | 0,02 |
| 722 | Industria de Diseno Textil SA | 25.488 | 0,08 |
| 1.188 | Industrivarden AB | 28.669 | 0,09 |
| 889 | Infineon Technologies AG | 20.267 | 0,06 |
| 545 | Informa Plc | 6.187 | 0,02 |
| 2.278 | Infratil Ltd | 7.746 | 0,02 |
| 3.001 | ING Groep NV | 36.003 | 0,11 |
| 195 | Ingersoll-Rand Plc | 25.919 | 0,08 |
| 400 | Inpex Corp | 4.183 | 0,01 |
| 1.010 | Insurance Australia Group Ltd | 5.438 | 0,02 |
| 100 | Intact Financial Corp | 10.829 | 0,03 |
| 3.392 | Intel Corp | 203.011 | 0,63 |
| 300 | Inter Pipeline Ltd | 5.215 | 0,02 |
| 355 | Intercontinental Exchange Inc | 32.855 | 0,10 |
| 89 | InterContinental Hotels Group Plc | 6.140 | 0,02 |
| 639 | International Business Machines Corp | 85.652 | 0,27 |
| 625 | International Consolidated Airlines Group SA | 5.175 | 0,02 |
| 42 | International Flavors & Fragrances Inc | 5.419 | 0,02 |
| 359 | International Paper Co | 16.532 | 0,05 |
| 216 | Interpublic Group of Cos Inc/The | 4.990 | 0,02 |
| 82 | Intertek Group Plc | 6.357 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 11.921 | Intesa Sanpaolo SpA | 31.425 | 0,10 |
| 185 | Intuit Inc | 48.457 | 0,15 |
| 82 | Intuitive Surgical Inc | 48.474 | 0,15 |
| 230 | Invesco Ltd | 4.135 | 0,01 |
| 972 | Investor AB | 53.080 | 0,17 |
| 606 | Invitation Homes Inc (REIT) | 18.162 | 0,06 |
| 162 | IQVIA Holdings Inc | 25.031 | 0,08 |
| 158 | Iron Mountain Inc (REIT) | 5.035 | 0,02 |
| 153 | ISS A/S | 3.674 | 0,01 |
| 400 | Isuzu Motors Ltd | 4.781 | 0,01 |
| 1.200 | ITOCHU Corp | 27.986 | 0,09 |
| 2.481 | ITV Plc | 4.963 | 0,02 |
| 1.226 | J Sainsbury Plc | 3.734 | 0,01 |
| 500 | Japan Airlines Co Ltd | 15.629 | 0,05 |
| 300 | Japan Exchange Group Inc | 5.328 | 0,02 |
| 600 | Japan Post Holdings Co Ltd | 5.665 | 0,02 |
| 3 | Japan Retail Fund Investment Corp (REIT) | 6.440 | 0,02 |
| 1.500 | Japan Tobacco Inc | 33.575 | 0,10 |
| 100 | Jardine Matheson Holdings Ltd | 5.560 | 0,02 |
| 100 | Jardine Strategic Holdings Ltd | 3.065 | 0,01 |
| 31 | Jazz Pharmaceuticals Plc | 4.628 | 0,01 |
| 46 | JB Hunt Transport Services Inc | 5.372 | 0,02 |
| 300 | JFE Holdings Inc | 3.895 | 0,01 |
| 46 | JM Smucker Co/The | 4.790 | 0,01 |
| 708 | Johnson Controls International plc | 28.823 | 0,09 |
| 128 | Johnson Matthey Plc | 5.080 | 0,02 |
| 2.220 | JPMorgan Chase & Co | 309.468 | 0,97 |
| 168 | Juniper Networks Inc | 4.138 | 0,01 |
| 1.400 | JXTG Holdings Inc | 6.414 | 0,02 |
| 400 | Kajima Corp | 5.366 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|----------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.500 | Kansai Electric Power Co Inc/The | 17.453 | 0,05 |
| 49 | Kansas City Southern | 7.505 | 0,02 |
| 400 | Kao Corp | 33.218 | 0,10 |
| 314 | KBC Group NV | 23.636 | 0,07 |
| 1.100 | KDDI Corp | 32.927 | 0,10 |
| 100 | Keio Corp | 6.082 | 0,02 |
| 500 | Keisei Electric Railway Co Ltd | 19.508 | 0,06 |
| 106 | Kellogg Co | 7.331 | 0,02 |
| 1.100 | Keppel Corp Ltd | 5.538 | 0,02 |
| 53 | Kering SA | 34.814 | 0,11 |
| 136 | Kerry Group Plc | 16.960 | 0,05 |
| 745 | Keurig Dr Pepper Inc | 21.568 | 0,07 |
| 1.082 | KeyCorp | 21.900 | 0,07 |
| 200 | Keyence Corp | 70.835 | 0,22 |
| 187 | Keysight Technologies Inc | 19.192 | 0,06 |
| 100 | Kikkoman Corp | 4.941 | 0,02 |
| 264 | Kimberly-Clark Corp | 36.313 | 0,11 |
| 315 | Kimco Realty Corp (REIT) | 6.524 | 0,02 |
| 1.433 | Kinder Morgan Inc/DE | 30.337 | 0,09 |
| 1.509 | Kingfisher Plc | 4.338 | 0,01 |
| 112 | Kingspan Group Plc | 6.845 | 0,02 |
| 188 | Kinnevik AB | 4.599 | 0,01 |
| 1.500 | Kinross Gold Corp | 7.126 | 0,02 |
| 100 | Kintetsu Group Holdings Co Ltd | 5.447 | 0,02 |
| 400 | Kirin Holdings Co Ltd | 8.797 | 0,03 |
| 114 | Kirkland Lake Gold Ltd | 5.032 | 0,02 |
| 208 | KKR & Co Inc | 6.067 | 0,02 |
| 64 | KLA Corp | 11.403 | 0,04 |
| 148 | Klepierre SA (REIT) | 5.623 | 0,02 |
| 100 | Koito Manufacturing Co Ltd | 4.693 | 0,01 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 900 | Komatsu Ltd | 21.880 | 0,07 |
| 144 | Kone Oyj - Class B | 9.420 | 0,03 |
| 790 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | 19.770 | 0,06 |
| 279 | Koninklijke DSM NV | 36.359 | 0,11 |
| 1.850 | Koninklijke KPN NV | 5.464 | 0,02 |
| 706 | Koninklijke Philips NV | 34.488 | 0,11 |
| 343 | Kraft Heinz Co/The | 11.021 | 0,03 |
| 596 | Kroger Co/The | 17.278 | 0,05 |
| 1.000 | Kubota Corp | 15.882 | 0,05 |
| 37 | Kuehne + Nagel International AG | 6.236 | 0,02 |
| 400 | Kuraray Co Ltd | 4.899 | 0,02 |
| 300 | Kyocera Corp | 20.649 | 0,06 |
| 400 | Kyushu Electric Power Co Inc | 3.478 | 0,01 |
| 144 | L3Harris Technologies Inc | 28.493 | 0,09 |
| 39 | Laboratory Corp of America Holdings | 6.598 | 0,02 |
| 178 | LafargeHolcim Ltd | 9.871 | 0,03 |
| 115 | Lam Research Corp | 33.626 | 0,10 |
| 448 | Land Securities Group Plc (REIT) | 5.876 | 0,02 |
| 321 | Las Vegas Sands Corp | 22.162 | 0,07 |
| 37 | Lear Corp | 5.076 | 0,02 |
| 5.418 | Legal & General Group Plc | 21.748 | 0,07 |
| 113 | Legrand SA | 9.214 | 0,03 |
| 80 | Leidos Holdings Inc | 7.831 | 0,02 |
| 404 | Lendlease Group | 4.998 | 0,02 |
| 28 | Lennar Corp | 1.562 | 0,00 |
| 370 | Lennar Corp | 16.539 | 0,05 |
| 109 | Liberty Broadband Corp | 13.577 | 0,04 |
| 60 | Liberty Broadband Corp | 7.545 | 0,02 |
| 264 | Liberty Global Plc | 5.754 | 0,02 |
| 123 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM | 5.921 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 82 | Lincoln National Corp | 4.839 | 0,01 |
| 358 | Linde Plc | 76.218 | 0,24 |
| 1.000 | Link REIT (Units) (REIT) | 10.588 | 0,03 |
| 180 | LKQ Corp | 6.426 | 0,02 |
| 49.277 | Lloyds Banking Group Plc | 40.800 | 0,13 |
| 100 | Loblaw Cos Ltd | 5.167 | 0,02 |
| 155 | Lockheed Martin Corp | 60.354 | 0,19 |
| 103 | Loews Corp | 5.406 | 0,02 |
| 272 | London Stock Exchange Group Plc | 27.926 | 0,09 |
| 69 | Lonza Group AG | 25.167 | 0,08 |
| 246 | L'Oreal SA | 72.898 | 0,23 |
| 525 | Lowe's Cos Inc | 62.874 | 0,20 |
| 105 | Lululemon Athletica Inc | 24.325 | 0,08 |
| 170 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 79.038 | 0,25 |
| 186 | Lyft Inc | 8.002 | 0,02 |
| 253 | LyondellBasell Industries NV | 23.903 | 0,07 |
| 1.854 | M&G Plc | 5.826 | 0,02 |
| 106 | M&T Bank Corp | 17.993 | 0,06 |
| 300 | M3 Inc | 9.124 | 0,03 |
| 296 | Macquarie Group Ltd | 28.683 | 0,09 |
| 300 | Magna International Inc (Units) | 16.472 | 0,05 |
| 100 | Makita Corp | 3.506 | 0,01 |
| 1.445 | Manulife Financial Corp | 29.374 | 0,09 |
| 336 | Marathon Oil Corp | 4.563 | 0,01 |
| 501 | Marathon Petroleum Corp | 30.185 | 0,09 |
| 5 | Markel Corp | 5.716 | 0,02 |
| 1.290 | Marks & Spencer Group Plc | 3.649 | 0,01 |
| 211 | Marriott International Inc/MD | 31.952 | 0,10 |
| 302 | Marsh & McLennan Cos Inc | 33.646 | 0,10 |
| 29 | Martin Marietta Materials Inc | 8.110 | 0,03 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 800 | Marubeni Corp | 5.967 | 0,02 |
| 292 | Marvell Technology Group Ltd | 7.756 | 0,02 |
| 159 | Masco Corp | 7.630 | 0,02 |
| 651 | Mastercard Inc | 194.382 | 0,61 |
| 311 | Maxim Integrated Products Inc | 19.130 | 0,06 |
| 1.800 | Mazda Motor Corp | 15.536 | 0,05 |
| 47 | McCormick & Co Inc/MD | 7.977 | 0,02 |
| 551 | McDonald's Corp | 108.883 | 0,34 |
| 149 | McKesson Corp | 20.610 | 0,06 |
| 559 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | 6.158 | 0,02 |
| 1.380 | Medtronic Plc | 156.561 | 0,49 |
| 100 | MEIJI Holdings Co Ltd | 6.791 | 0,02 |
| 278 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | 6.719 | 0,02 |
| 2.233 | Melrose Industries Plc | 7.103 | 0,02 |
| 36 | MercadoLibre Inc | 20.590 | 0,06 |
| 1.866 | Merck & Co Inc | 169.713 | 0,53 |
| 52 | Merck KGaA | 6.149 | 0,02 |
| 498 | MetLife Inc | 25.383 | 0,08 |
| 200 | Metro Inc/CN | 8.265 | 0,03 |
| 10 | Mettler-Toledo International Inc | 7.933 | 0,02 |
| 572 | MGM Resorts International | 19.030 | 0,06 |
| 513 | Micro Focus International Plc | 7.230 | 0,02 |
| 200 | Microchip Technology Inc | 20.944 | 0,07 |
| 817 | Micron Technology Inc | 43.938 | 0,14 |
| 5.752 | Microsoft Corp | 907.090 | 2,83 |
| 51 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | 6.725 | 0,02 |
| 169 | Middleby Corp/The | 18.509 | 0,06 |
| 88 | Millicom International Cellular SA SDR | 4.217 | 0,01 |
| 300 | MINEBEA MITSUMI Inc | 6.286 | 0,02 |
| 200 | MISUMI Group Inc | 5.009 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 600 | Mitsubishi Chemical Holdings Corp | 4.513 | 0,01 |
| 3.000 | Mitsubishi Corp | 80.055 | 0,25 |
| 1.600 | Mitsubishi Electric Corp | 22.062 | 0,07 |
| 600 | Mitsubishi Estate Co Ltd | 11.536 | 0,04 |
| 100 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd | 3.909 | 0,01 |
| 14.600 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | 79.694 | 0,25 |
| 3.300 | Mitsui & Co Ltd | 59.092 | 0,18 |
| 1.000 | Mitsui Fudosan Co Ltd | 24.587 | 0,08 |
| 18.600 | Mizuho Financial Group Inc | 28.805 | 0,09 |
| 39 | Mohawk Industries Inc | 5.319 | 0,02 |
| 79 | Molson Coors Beverage Co - Class B | 4.258 | 0,01 |
| 137 | Moncler SpA | 6.162 | 0,02 |
| 1.556 | Mondelez International Inc | 85.704 | 0,27 |
| 210 | Mondi Plc | 4.931 | 0,02 |
| 353 | Monster Beverage Corp | 22.433 | 0,07 |
| 136 | Moody's Corp | 32.288 | 0,10 |
| 936 | Morgan Stanley | 47.848 | 0,15 |
| 155 | Mosaic Co/The | 3.354 | 0,01 |
| 187 | Motorola Solutions Inc | 30.133 | 0,09 |
| 202 | Mowi ASA | 5.246 | 0,02 |
| 200 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | 6.645 | 0,02 |
| 34 | MSCI Inc - Class A | 8.778 | 0,03 |
| 1.019 | MTR Corp Ltd | 6.022 | 0,02 |
| 85 | MTU Aero Engines AG | 24.292 | 0,08 |
| 118 | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 34.835 | 0,11 |
| 400 | Murata Manufacturing Co Ltd | 24.830 | 0,08 |
| 626 | Mylan NV | 12.583 | 0,04 |
| 700 | Nagoya Railroad Co Ltd | 21.836 | 0,07 |
| 56 | Nasdaq Inc | 5.998 | 0,02 |
| 2.094 | National Australia Bank Ltd | 36.255 | 0,11 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-----------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 300 | National Bank of Canada | 16.676 | 0,05 |
| 2.573 | National Grid Plc | 32.187 | 0,10 |
| 152 | National Oilwell Varco Inc | 3.808 | 0,01 |
| 201 | Naturgy Energy Group SA | 5.054 | 0,02 |
| 200 | NEC Corp | 8.318 | 0,03 |
| 180 | Neste Oyj | 6.267 | 0,02 |
| 2.181 | Nestle SA | 235.989 | 0,74 |
| 106 | NetApp Inc | 6.598 | 0,02 |
| 306 | Netflix Inc | 99.012 | 0,31 |
| 4.000 | New World Development Co Ltd | 5.483 | 0,02 |
| 335 | Newcrest Mining Ltd | 7.124 | 0,02 |
| 250 | Newell Brands Inc | 4.805 | 0,01 |
| 975 | Newmont Goldcorp Corp | 42.364 | 0,13 |
| 400 | Nexon Co Ltd | 5.337 | 0,02 |
| 73 | Next Plc | 6.787 | 0,02 |
| 438 | NextEra Energy Inc | 106.066 | 0,33 |
| 48 | Nice Ltd | 7.443 | 0,02 |
| 200 | Nidec Corp | 27.614 | 0,09 |
| 187 | Nielsen Holdings Plc | 3.796 | 0,01 |
| 808 | NIKE Inc | 81.858 | 0,26 |
| 300 | Nikon Corp | 3.710 | 0,01 |
| 100 | Nintendo Co Ltd | 40.460 | 0,13 |
| 200 | Nippon Paint Holdings Co Ltd | 10.380 | 0,03 |
| 400 | Nippon Steel Corp | 6.088 | 0,02 |
| 1.600 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | 40.591 | 0,13 |
| 193 | NiSource Inc | 5.373 | 0,02 |
| 100 | Nissan Chemical Corp | 4.228 | 0,01 |
| 1.000 | Nissan Motor Co Ltd | 5.853 | 0,02 |
| 1.000 | Nisshin Seifun Group Inc | 17.539 | 0,05 |
| 100 | Nitori Holdings Co Ltd | 15.850 | 0,05 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 100 | Nitto Denko Corp | 5.687 | 0,02 |
| 159 | NMC Health Plc | 3.722 | 0,01 |
| 131 | NN Group NV | 4.973 | 0,02 |
| 186 | Noble Energy Inc | 4.620 | 0,01 |
| 3.993 | Nokia Oyj | 14.773 | 0,05 |
| 1.500 | Nomura Holdings Inc | 7.776 | 0,02 |
| 4 | Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT) | 6.831 | 0,02 |
| 300 | Nomura Research Institute Ltd | 6.454 | 0,02 |
| 2.231 | Nordea Bank Abp | 18.131 | 0,06 |
| 185 | Norfolk Southern Corp | 35.914 | 0,11 |
| 925 | Norsk Hydro ASA | 3.436 | 0,01 |
| 196 | Northern Trust Corp | 20.823 | 0,06 |
| 119 | Northrop Grumman Corp | 40.932 | 0,13 |
| 250 | NortonLifeLock Inc | 6.380 | 0,02 |
| 109 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | 6.367 | 0,02 |
| 1.836 | NOS SGPS SA | 9.892 | 0,03 |
| 1.816 | Novartis AG | 172.341 | 0,54 |
| 1.268 | Novo Nordisk A/S | 73.648 | 0,23 |
| 101 | Novozymes A/S | 4.946 | 0,02 |
| 400 | NTT Data Corp | 5.400 | 0,02 |
| 800 | NTT DOCOMO Inc | 22.364 | 0,07 |
| 296 | Nucor Corp | 16.659 | 0,05 |
| 500 | Nutrien Ltd | 23.972 | 0,07 |
| 529 | NVIDIA Corp | 124.474 | 0,39 |
| 2 | NVR Inc | 7.617 | 0,02 |
| 262 | NXP Semiconductors NV | 33.342 | 0,10 |
| 500 | Obayashi Corp | 5.599 | 0,02 |
| 100 | Obic Co Ltd | 13.582 | 0,04 |
| 682 | Occidental Petroleum Corp | 28.105 | 0,09 |
| 200 | Odakyu Electric Railway Co Ltd | 4.695 | 0,01 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 918 | Oil Search Ltd | 4.678 | 0,01 |
| 800 | Oji Holdings Corp | 4.380 | 0,01 |
| 800 | Olympus Corp | 12.433 | 0,04 |
| 224 | Omnicom Group Inc | 18.148 | 0,06 |
| 100 | Omron Corp | 5.908 | 0,02 |
| 107 | OMV AG | 6.015 | 0,02 |
| 368 | ONEOK Inc | 27.847 | 0,09 |
| 100 | Onex Corp | 6.337 | 0,02 |
| 200 | Ono Pharmaceutical Co Ltd | 4.605 | 0,01 |
| 200 | Open Text Corp | 8.825 | 0,03 |
| 1.640 | Oracle Corp | 86.887 | 0,27 |
| 1.621 | Orange SA | 23.872 | 0,07 |
| 62 | O'Reilly Automotive Inc | 27.172 | 0,08 |
| 100 | Oriental Land Co Ltd/Japan | 13.692 | 0,04 |
| 968 | Origin Energy Ltd | 5.750 | 0,02 |
| 1.400 | ORIX Corp | 23.330 | 0,07 |
| 587 | Orkla ASA | 5.943 | 0,02 |
| 76 | Orsted A/S '144A' | 7.866 | 0,02 |
| 300 | Osaka Gas Co Ltd | 5.772 | 0,02 |
| 200 | Otsuka Holdings Co Ltd | 8.986 | 0,03 |
| 1.782 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | 14.551 | 0,05 |
| 137 | PACCAR Inc | 10.837 | 0,03 |
| 52 | Packaging Corp of America | 5.823 | 0,02 |
| 80 | Palo Alto Networks Inc | 18.500 | 0,06 |
| 400 | Pan Pacific International Holdings Corp | 6.666 | 0,02 |
| 2.500 | Panasonic Corp | 23.683 | 0,07 |
| 132 | Parker-Hannifin Corp | 27.168 | 0,08 |
| 8 | Partners Group Holding AG | 7.331 | 0,02 |
| 197 | Paychex Inc | 16.757 | 0,05 |
| 1.020 | PayPal Holdings Inc | 110.333 | 0,34 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 423 | Pearson Plc | 3.570 | 0,01 |
| 500 | Pembina Pipeline Corp | 18.558 | 0,06 |
| 1.100 | PepsiCo Inc | 150.337 | 0,47 |
| 136 | Pernod Ricard SA | 24.334 | 0,08 |
| 69 | Perrigo Co Plc | 3.565 | 0,01 |
| 162 | Persimmon Plc | 5.784 | 0,02 |
| 223 | Peugeot SA | 5.332 | 0,02 |
| 4.228 | Pfizer Inc | 165.653 | 0,52 |
| 1.296 | Philip Morris International Inc | 110.277 | 0,34 |
| 320 | Phillips 66 | 35.651 | 0,11 |
| 100 | Pigeon Corp | 3.694 | 0,01 |
| 60 | Pinnacle West Capital Corp | 5.396 | 0,02 |
| 162 | Pioneer Natural Resources Co | 24.522 | 0,08 |
| 283 | PNC Financial Services Group Inc/The | 45.175 | 0,14 |
| 75 | Porsche Automobil Holding SE - Preference | 5.610 | 0,02 |
| 1.000 | Power Assets Holdings Ltd | 7.315 | 0,02 |
| 200 | Power Corp of Canada | 5.159 | 0,02 |
| 182 | PPG Industries Inc | 24.295 | 0,08 |
| 569 | PPL Corp | 20.416 | 0,06 |
| 106 | Principal Financial Group Inc | 5.830 | 0,02 |
| 1.741 | Procter & Gamble Co/The | 217.451 | 0,68 |
| 416 | Progressive Corp/The | 30.114 | 0,09 |
| 447 | Prologis Inc (REIT) | 39.846 | 0,12 |
| 465 | Prosus NV | 34.726 | 0,11 |
| 279 | Prudential Financial Inc | 26.153 | 0,08 |
| 1.854 | Prudential Plc | 35.589 | 0,11 |
| 364 | Public Service Enterprise Group Inc | 21.494 | 0,07 |
| 101 | Public Storage (REIT) | 21.509 | 0,07 |
| 84 | Publicis Groupe SA | 3.805 | 0,01 |
| 202 | PulteGroup Inc | 7.838 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 39 | PVH Corp | 4.101 | 0,01 |
| 1.243 | Qantas Airways Ltd | 6.213 | 0,02 |
| 615 | QBE Insurance Group Ltd | 5.568 | 0,02 |
| 72 | Qorvo Inc | 8.369 | 0,03 |
| 968 | QUALCOMM Inc | 85.407 | 0,27 |
| 53 | Quest Diagnostics Inc | 5.660 | 0,02 |
| 700 | Rakuten Inc | 6.023 | 0,02 |
| 382 | Ramsay Health Care Ltd | 19.476 | 0,06 |
| 102 | Randstad NV | 6.233 | 0,02 |
| 63 | Raymond James Financial Inc | 5.636 | 0,02 |
| 204 | Raytheon Co | 44.827 | 0,14 |
| 284 | Realty Income Corp (REIT) | 20.911 | 0,07 |
| 492 | Reckitt Benckiser Group Plc | 39.947 | 0,12 |
| 900 | Recruit Holdings Co Ltd | 33.946 | 0,11 |
| 240 | Red Electrica Corp SA | 4.829 | 0,01 |
| 79 | Regency Centers Corp (REIT) | 4.984 | 0,02 |
| 59 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 22.153 | 0,07 |
| 1.244 | Regions Financial Corp | 21.347 | 0,07 |
| 35 | Reinsurance Group of America Inc - Class A | 5.707 | 0,02 |
| 1.372 | RELX Plc | 34.634 | 0,11 |
| 71 | Renault SA | 3.362 | 0,01 |
| 1.251 | Rentokil Initial Plc | 7.507 | 0,02 |
| 1.264 | Repsol SA | 19.764 | 0,06 |
| 87 | Republic Services Inc - Class A | 7.798 | 0,02 |
| 55 | ResMed Inc | 8.523 | 0,03 |
| 1.000 | Resona Holdings Inc | 4.408 | 0,01 |
| 100 | Restaurant Brands International Inc | 6.384 | 0,02 |
| 500 | Ricoh Co Ltd | 5.484 | 0,02 |
| 331 | Rio Tinto Ltd | 23.361 | 0,07 |
| 784 | Rio Tinto Plc | 46.768 | 0,15 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.000 | RioCan Real Estate Investment Trust (Units) (REIT) | 20.636 | 0,06 |
| 150 | Roche Holding AG | 47.647 | 0,15 |
| 457 | Roche Holding AG | 148.185 | 0,46 |
| 125 | Rockwell Automation Inc | 25.334 | 0,08 |
| 300 | Rogers Communications Inc | 14.917 | 0,05 |
| 100 | Rohm Co Ltd | 8.079 | 0,03 |
| 357 | Rollins Inc | 11.838 | 0,04 |
| 118.499 | Rolls-Royce Group Plc - Preference | 157 | 0,00 |
| 1.669 | Rolls-Royce Holdings Plc | 15.106 | 0,05 |
| 76.774 | Rolls-Royce Holdings Plc - Preference | 102 | 0,00 |
| 81 | Roper Technologies Inc | 28.693 | 0,09 |
| 267 | Ross Stores Inc | 31.084 | 0,10 |
| 800 | Royal Bank of Canada | 63.390 | 0,20 |
| 1.692 | Royal Bank of Scotland Group Plc | 5.386 | 0,02 |
| 144 | Royal Caribbean Cruises Ltd | 19.225 | 0,06 |
| 1.168 | Royal Dutch Shell Plc | 34.652 | 0,11 |
| 5.229 | Royal Dutch Shell Plc | 154.821 | 0,48 |
| 704 | RSA Insurance Group Plc | 5.275 | 0,02 |
| 583 | RWE AG | 17.898 | 0,06 |
| 403 | Ryanair Holdings Plc | 6.618 | 0,02 |
| 178 | S&P Global Inc | 48.603 | 0,15 |
| 264 | Safran SA | 40.790 | 0,13 |
| 692 | Sage Group Plc/The | 6.866 | 0,02 |
| 605 | salesforce.com Inc | 98.397 | 0,31 |
| 390 | Sampo Oyj - Class A | 17.034 | 0,05 |
| 1.200 | Sands China Ltd | 6.414 | 0,02 |
| 478 | Sandvik AB | 9.327 | 0,03 |
| 721 | Sanofi | 72.530 | 0,23 |
| 300 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | 5.758 | 0,02 |
| 1.089 | Santos Ltd | 6.262 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 748 | SAP SE | 101.022 | 0,32 |
| 200 | Saputo Inc | 6.200 | 0,02 |
| 44 | SBA Communications Corp (REIT) - Class A | 10.604 | 0,03 |
| 200 | SBI Holdings Inc/Japan | 4.260 | 0,01 |
| 1.963 | Scentre Group (REIT) | 5.285 | 0,02 |
| 527 | Schibsted ASA | 15.911 | 0,05 |
| 151 | Schibsted ASA - Class B | 4.327 | 0,01 |
| 25 | Schindler Holding AG | 6.356 | 0,02 |
| 987 | Schlumberger Ltd | 39.677 | 0,12 |
| 386 | Schneider Electric SE | 39.645 | 0,12 |
| 146 | Schroders Plc | 6.448 | 0,02 |
| 111 | Seagate Technology Plc | 6.605 | 0,02 |
| 357 | Sealed Air Corp | 14.219 | 0,04 |
| 87 | Seattle Genetics Inc | 9.941 | 0,03 |
| 100 | Secom Co Ltd | 8.997 | 0,03 |
| 624 | Segro Plc (REIT) | 7.417 | 0,02 |
| 93 | SEI Investments Co | 6.090 | 0,02 |
| 300 | Sekisui Chemical Co Ltd | 5.256 | 0,02 |
| 300 | Sekisui House Ltd | 6.442 | 0,02 |
| 198 | Sempra Energy | 29.993 | 0,09 |
| 145 | ServiceNow Inc | 40.936 | 0,13 |
| 600 | Seven & i Holdings Co Ltd | 22.101 | 0,07 |
| 473 | Severn Trent Plc | 15.759 | 0,05 |
| 2 | SGS SA | 5.475 | 0,02 |
| 300 | Shaw Communications Inc | 6.096 | 0,02 |
| 65 | Sherwin-Williams Co/The | 37.930 | 0,12 |
| 200 | Shimadzu Corp | 6.331 | 0,02 |
| 100 | Shimano Inc | 16.352 | 0,05 |
| 300 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 33.292 | 0,10 |
| 200 | Shionogi & Co Ltd | 12.454 | 0,04 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|----------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 400 | Shiseido Co Ltd | 28.643 | 0,09 |
| 100 | Shopify Inc - Class A | 39.815 | 0,12 |
| 100 | Showa Denko KK | 2.668 | 0,01 |
| 844 | Siemens AG | 110.407 | 0,34 |
| 118 | Siemens Healthineers AG '144A' | 5.672 | 0,02 |
| 168 | Signature Bank/New York NY | 22.950 | 0,07 |
| 141 | Sika AG | 26.478 | 0,08 |
| 208 | Simon Property Group Inc (REIT) | 30.984 | 0,10 |
| 3.100 | Singapore Exchange Ltd | 20.426 | 0,06 |
| 3.700 | Singapore Telecommunications Ltd | 9.273 | 0,03 |
| 5.000 | Sino Biopharmaceutical Ltd | 6.995 | 0,02 |
| 8.000 | Sino Land Co Ltd | 11.622 | 0,04 |
| 818 | Sirius XM Holdings Inc | 5.849 | 0,02 |
| 701 | Skandinaviska Enskilda Banken AB | 6.596 | 0,02 |
| 315 | Skanska AB | 7.124 | 0,02 |
| 307 | SKF AB | 6.211 | 0,02 |
| 3.439 | SKYCITY Entertainment Group Ltd | 9.211 | 0,03 |
| 75 | Skyworks Solutions Inc | 9.066 | 0,03 |
| 54 | SL Green Realty Corp (REIT) | 4.962 | 0,02 |
| 100 | SMC Corp/Japan | 46.276 | 0,14 |
| 316 | Smith & Nephew Plc | 7.671 | 0,02 |
| 285 | Smiths Group Plc | 6.369 | 0,02 |
| 154 | Smurfit Kappa Group Plc | 5.922 | 0,02 |
| 1.184 | Snam SpA | 6.228 | 0,02 |
| 769 | Snap Inc | 12.558 | 0,04 |
| 32 | Snap-on Inc | 5.421 | 0,02 |
| 657 | Societe Generale SA | 22.873 | 0,07 |
| 51 | Sodexo SA | 6.048 | 0,02 |
| 2.000 | Softbank Corp | 26.860 | 0,08 |
| 1.200 | SoftBank Group Corp | 52.516 | 0,16 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|----------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 43 | Solvay SA | 4.986 | 0,02 |
| 200 | Sompo Holdings Inc | 7.914 | 0,02 |
| 308 | Sonic Healthcare Ltd | 6.225 | 0,02 |
| 1.000 | Sony Corp | 68.102 | 0,21 |
| 1.956 | South32 Ltd | 3.712 | 0,01 |
| 651 | Southern Co/The (Units) | 41.469 | 0,13 |
| 361 | Southwest Airlines Co | 19.487 | 0,06 |
| 1.884 | Spark New Zealand Ltd | 5.504 | 0,02 |
| 160 | Splunk Inc | 23.963 | 0,07 |
| 43 | Spotify Technology SA | 6.431 | 0,02 |
| 200 | Square Enix Holdings Co Ltd | 9.993 | 0,03 |
| 227 | Square Inc | 14.201 | 0,04 |
| 344 | SS&C Technologies Holdings Inc | 21.122 | 0,07 |
| 3.319 | SSAB AB - Class B | 10.821 | 0,03 |
| 1.064 | SSE Plc | 20.276 | 0,06 |
| 378 | St James's Place Plc | 5.831 | 0,02 |
| 2.903 | Standard Chartered Plc | 27.397 | 0,09 |
| 1.420 | Standard Life Aberdeen Plc | 6.172 | 0,02 |
| 127 | Stanley Black & Decker Inc | 21.049 | 0,07 |
| 865 | Starbucks Corp | 76.051 | 0,24 |
| 263 | State Street Corp | 20.803 | 0,06 |
| 122 | Steel Dynamics Inc | 4.153 | 0,01 |
| 331 | STMicroelectronics NV | 8.906 | 0,03 |
| 333 | Stora Enso Oyj | 4.846 | 0,02 |
| 202 | Stryker Corp | 42.408 | 0,13 |
| 300 | Subaru Corp | 7.491 | 0,02 |
| 1.000 | Sumitomo Chemical Co Ltd | 4.582 | 0,01 |
| 3.600 | Sumitomo Corp | 53.797 | 0,17 |
| 400 | Sumitomo Electric Industries Ltd | 6.081 | 0,02 |
| 200 | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | 6.522 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 37.157 | 0,12 |
| 200 | Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc | 7.982 | 0,02 |
| 200 | Sumitomo Realty & Development Co Ltd | 7.015 | 0,02 |
| 1.500 | Sun Hung Kai Properties Ltd | 22.966 | 0,07 |
| 600 | Sun Life Financial Inc | 27.396 | 0,09 |
| 1.200 | Suncor Energy Inc | 39.385 | 0,12 |
| 542 | Suncorp Group Ltd | 4.938 | 0,02 |
| 100 | Suntory Beverage & Food Ltd | 4.182 | 0,01 |
| 200 | Suzuki Motor Corp | 8.405 | 0,03 |
| 21 | SVB Financial Group | 5.272 | 0,02 |
| 542 | Svenska Cellulosa AB SCA - Class B | 5.500 | 0,02 |
| 581 | Svenska Handelsbanken AB | 6.262 | 0,02 |
| 15 | Swatch Group AG/The | 4.182 | 0,01 |
| 845 | Swedbank AB | 12.588 | 0,04 |
| 97 | Swedish Match AB | 5.003 | 0,02 |
| 500 | Swire Pacific Ltd | 4.646 | 0,01 |
| 276 | Swiss Re AG | 30.981 | 0,10 |
| 11 | Swisscom AG | 5.823 | 0,02 |
| 1.096 | Sydney Airport | 6.672 | 0,02 |
| 209 | Symrise AG - Class A | 22.005 | 0,07 |
| 647 | Synchrony Financial | 23.298 | 0,07 |
| 201 | Synopsys Inc | 27.979 | 0,09 |
| 325 | Sysco Corp | 27.801 | 0,09 |
| 100 | Systemex Corp | 6.854 | 0,02 |
| 222 | T Rowe Price Group Inc | 27.048 | 0,08 |
| 300 | T&D Holdings Inc | 3.851 | 0,01 |
| 1.499 | Tabcorp Holdings Ltd | 4.773 | 0,01 |
| 100 | Taisei Corp | 4.182 | 0,01 |
| 1.400 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | 55.807 | 0,17 |
| 44 | Take-Two Interactive Software Inc | 5.387 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 117 | Tapestry Inc | 3.155 | 0,01 |
| 96 | Targa Resources Corp | 3.920 | 0,01 |
| 404 | Target Corp | 51.797 | 0,16 |
| 2.325 | Taylor Wimpey Plc | 5.957 | 0,02 |
| 619 | TC Energy Corp | 33.014 | 0,10 |
| 121 | TD Ameritrade Holding Corp | 6.014 | 0,02 |
| 100 | TDK Corp | 11.401 | 0,04 |
| 279 | TE Connectivity Ltd | 26.739 | 0,08 |
| 187 | TechnipFMC Plc | 4.009 | 0,01 |
| 1.000 | Techtronic Industries Co Ltd | 8.156 | 0,03 |
| 8.192 | Telecom Italia SpA/Milano | 5.116 | 0,02 |
| 19 | Teleflex Inc | 7.152 | 0,02 |
| 2.390 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B | 20.823 | 0,06 |
| 3.760 | Telefonica SA | 26.281 | 0,08 |
| 168 | Telenet Group Holding NV | 7.554 | 0,02 |
| 296 | Telenor ASA | 5.304 | 0,02 |
| 1.076 | Telia Co AB | 4.627 | 0,01 |
| 9.050 | Telstra Corp Ltd | 22.520 | 0,07 |
| 506 | TELUS Corp (Units) | 19.620 | 0,06 |
| 326 | Tenaris SA | 3.678 | 0,01 |
| 955 | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | 6.383 | 0,02 |
| 600 | Terumo Corp | 21.449 | 0,07 |
| 7.325 | Tesco Plc | 24.764 | 0,08 |
| 100 | Tesla Inc | 41.833 | 0,13 |
| 1.205 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd | 11.935 | 0,04 |
| 631 | Texas Instruments Inc | 80.951 | 0,25 |
| 91 | Textron Inc | 4.059 | 0,01 |
| 45 | Thales SA | 4.673 | 0,01 |
| 378 | Thermo Fisher Scientific Inc | 122.801 | 0,38 |
| 90 | Thomson Reuters Corp | 6.447 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 230 | thyssenkrupp AG | 3.108 | 0,01 |
| 44 | Tiffany & Co | 5.881 | 0,02 |
| 781 | TJX Cos Inc/The | 47.688 | 0,15 |
| 287 | T-Mobile US Inc | 22.507 | 0,07 |
| 200 | Tobu Railway Co Ltd | 7.279 | 0,02 |
| 400 | Tohoku Electric Power Co Inc | 3.983 | 0,01 |
| 600 | Tokio Marine Holdings Inc | 33.783 | 0,11 |
| 100 | Tokyo Electron Ltd | 22.015 | 0,07 |
| 200 | Tokyo Gas Co Ltd | 4.880 | 0,02 |
| 300 | Tokyu Corp | 5.573 | 0,02 |
| 700 | Toray Industries Inc | 4.774 | 0,01 |
| 1.100 | Toronto-Dominion Bank/The | 61.781 | 0,19 |
| 2.146 | TOTAL SA | 118.515 | 0,37 |
| 100 | TOTO Ltd | 4.270 | 0,01 |
| 100 | Toyota Industries Corp | 5.825 | 0,02 |
| 2.200 | Toyota Motor Corp | 156.161 | 0,49 |
| 100 | Toyota Tsusho Corp | 3.552 | 0,01 |
| 53 | Tractor Supply Co | 4.952 | 0,02 |
| 49 | TransDigm Group Inc | 27.440 | 0,09 |
| 223 | TransUnion | 19.091 | 0,06 |
| 2.009 | Transurban Group | 21.056 | 0,07 |
| 185 | Travelers Cos Inc/The | 25.336 | 0,08 |
| 448 | Treasury Wine Estates Ltd | 5.114 | 0,02 |
| 100 | Trend Micro Inc/Japan | 5.153 | 0,02 |
| 138 | Trimble Inc | 5.753 | 0,02 |
| 1.003 | Truist Financial Corp | 56.489 | 0,18 |
| 82 | Twilio Inc - Class A | 8.059 | 0,03 |
| 526 | Twitter Inc | 16.858 | 0,05 |
| 241 | Tyson Foods Inc - Class A | 21.941 | 0,07 |
| 2.879 | UBS Group AG | 36.345 | 0,11 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 60 | UCB SA | 4.775 | 0,01 |
| 126 | UDR Inc (REIT) | 5.884 | 0,02 |
| 92 | UGI Corp | 4.155 | 0,01 |
| 60 | Ulta Beauty Inc | 15.188 | 0,05 |
| 104 | Umicore SA | 5.062 | 0,02 |
| 233 | Under Armour Inc | 4.469 | 0,01 |
| 122 | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | 19.261 | 0,06 |
| 200 | Unicharm Corp | 6.809 | 0,02 |
| 2.006 | UniCredit SpA | 29.317 | 0,09 |
| 961 | Unilever NV | 55.262 | 0,17 |
| 702 | Unilever Plc | 40.459 | 0,13 |
| 545 | Union Pacific Corp | 98.531 | 0,31 |
| 218 | United Airlines Holdings Inc | 19.204 | 0,06 |
| 1.500 | United Overseas Bank Ltd | 29.462 | 0,09 |
| 460 | United Parcel Service Inc - Class B | 53.848 | 0,17 |
| 39 | United Rentals Inc | 6.504 | 0,02 |
| 918 | United Technologies Corp | 137.480 | 0,43 |
| 517 | United Utilities Group Plc | 6.461 | 0,02 |
| 697 | UnitedHealth Group Inc | 204.904 | 0,64 |
| 40 | Universal Health Services Inc | 5.738 | 0,02 |
| 538 | UPM-Kymmene Oyj | 18.666 | 0,06 |
| 911 | US Bancorp | 54.013 | 0,17 |
| 500 | USS Co Ltd | 9.505 | 0,03 |
| 20 | Vail Resorts Inc | 4.797 | 0,01 |
| 307 | Valero Energy Corp | 28.751 | 0,09 |
| 41 | Varian Medical Systems Inc | 5.822 | 0,02 |
| 139 | Veeva Systems Inc - Class A | 19.552 | 0,06 |
| 269 | Ventas Inc (REIT) | 15.532 | 0,05 |
| 664 | VEREIT Inc (REIT) | 6.135 | 0,02 |
| 43 | VeriSign Inc | 8.285 | 0,03 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 167 | Verisk Analytics Inc - Class A | 24.940 | 0,08 |
| 3.424 | Verizon Communications Inc | 210.234 | 0,66 |
| 190 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 41.600 | 0,13 |
| 88 | Vestas Wind Systems A/S | 8.899 | 0,03 |
| 230 | VF Corp | 22.922 | 0,07 |
| 454 | ViacomCBS Inc - Class B | 19.054 | 0,06 |
| 374 | Vinci SA | 41.561 | 0,13 |
| 1.176 | Visa Inc - Class A | 220.970 | 0,69 |
| 840 | Vivendi SA | 24.345 | 0,08 |
| 35 | VMware Inc | 5.313 | 0,02 |
| 18.340 | Vodafone Group Plc | 35.657 | 0,11 |
| 694 | Volvo AB | 11.729 | 0,04 |
| 780 | Volvo AB | 13.074 | 0,04 |
| 389 | Vonovia SE | 20.959 | 0,07 |
| 74 | Vornado Realty Trust (REIT) | 4.921 | 0,02 |
| 52 | Vulcan Materials Co | 7.487 | 0,02 |
| 572 | Walgreens Boots Alliance Inc | 33.725 | 0,11 |
| 1.015 | Walmart Inc | 120.623 | 0,38 |
| 1.291 | Walt Disney Co/The | 186.717 | 0,58 |
| 282 | Wartsila OYJ Abp | 3.118 | 0,01 |
| 200 | Waste Connections Inc | 18.192 | 0,06 |
| 261 | Waste Management Inc | 29.744 | 0,09 |
| 30 | Waters Corp | 7.009 | 0,02 |
| 252 | WEC Energy Group Inc | 23.242 | 0,07 |
| 19 | WellCare Health Plans Inc | 6.274 | 0,02 |
| 270 | Welltower Inc (REIT) | 22.081 | 0,07 |
| 956 | Wesfarmers Ltd | 27.822 | 0,09 |
| 100 | West Japan Railway Co | 8.687 | 0,03 |
| 110 | Western Digital Corp | 6.982 | 0,02 |
| 271 | Western Union Co/The | 7.257 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 89 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | 6.924 | 0,02 |
| 2.548 | Westpac Banking Corp | 43.399 | 0,14 |
| 110 | Westrock Co | 4.720 | 0,01 |
| 651 | Weyerhaeuser Co (REIT) | 19.660 | 0,06 |
| 7.000 | WH Group Ltd '144A' | 7.232 | 0,02 |
| 1.000 | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | 6.103 | 0,02 |
| 302 | Wheaton Precious Metals Corp | 8.999 | 0,03 |
| 2.000 | Wheelock & Co Ltd | 13.335 | 0,04 |
| 43 | Whirlpool Corp | 6.344 | 0,02 |
| 63 | Whitbread Plc | 4.044 | 0,01 |
| 929 | Williams Cos Inc/The | 22.036 | 0,07 |
| 135 | Willis Towers Watson Plc | 27.262 | 0,09 |
| 108 | Wirecard AG | 13.032 | 0,04 |
| 89 | Wix.com Ltd | 10.892 | 0,03 |
| 1.509 | Wm Morrison Supermarkets Plc | 3.994 | 0,01 |
| 113 | Wolters Kluwer NV | 8.247 | 0,03 |
| 984 | Woodside Petroleum Ltd | 23.781 | 0,07 |
| 1.178 | Woolworths Group Ltd | 29.943 | 0,09 |
| 114 | Workday Inc - Class A | 18.747 | 0,06 |
| 215 | WP Carey Inc (REIT) | 17.209 | 0,05 |
| 444 | WPP Plc | 6.273 | 0,02 |
| 97 | WR Berkley Corp | 6.703 | 0,02 |
| 18 | WW Grainger Inc | 6.093 | 0,02 |
| 159 | Wynn Resorts Ltd | 22.080 | 0,07 |
| 401 | Xcel Energy Inc | 25.459 | 0,08 |
| 177 | Xilinx Inc | 17.305 | 0,05 |
| 73 | Xylem Inc/NY | 5.752 | 0,02 |
| 100 | Yakult Honsha Co Ltd | 5.549 | 0,02 |
| 100 | Yamaha Corp | 5.595 | 0,02 |
| 300 | Yamaha Motor Co Ltd | 6.081 | 0,02 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|----------------------------|-------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung) | | | |
| 200 | Yamato Holdings Co Ltd | 3.436 | 0,01 |
| 113 | Yara International ASA | 4.696 | 0,01 |
| 200 | Yaskawa Electric Corp | 7.674 | 0,02 |
| 154 | Yum China Holdings Inc | 7.394 | 0,02 |
| 273 | Yum! Brands Inc | 27.499 | 0,09 |
| 1.700 | Z Holdings Corp | 7.211 | 0,02 |
| 167 | Zalando SE '144A' | 8.469 | 0,03 |
| 176 | Zimmer Biomet Holdings Inc | 26.344 | 0,08 |
| 103 | Zions Bancorp NA | 5.348 | 0,02 |
| 401 | Zoetis Inc | 53.072 | 0,17 |
| 97 | Zurich Insurance Group AG | 39.777 | 0,12 |
| Stammaktien insgesamt | | 31.863.399 | 99,56 |
| Gesamtanlagen | | | |
| Stammaktien | | 31.863.399 | 99,56 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | 140.574 | 0,44 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 32.003.973 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamtvermögens |
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | | 99,55 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | 0,45 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|--|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) | | | |
| 28.257 | A2A SpA | 47.246 | 0,05 |
| 2.676 | AAK AB | 45.332 | 0,04 |
| 32.725 | ABB Ltd | 703.587 | 0,68 |
| 8.129 | ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A' | 131.852 | 0,13 |
| 2.835 | Accor SA | 118.361 | 0,11 |
| 402 | Ackermans & van Haaren NV | 56.159 | 0,05 |
| 4.148 | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | 147.876 | 0,14 |
| 2.592 | Adevinta ASA | 27.330 | 0,03 |
| 3.111 | adidas AG | 901.568 | 0,88 |
| 218 | Adyen NV '144A' | 159.358 | 0,15 |
| 1.355 | Aena SME SA '144A' | 231.028 | 0,22 |
| 2.319 | AerCap Holdings NV | 126.995 | 0,12 |
| 607 | Aeroports de Paris | 106.893 | 0,10 |
| 2.097 | Ageas | 110.470 | 0,11 |
| 14.541 | AIB Group Plc | 45.164 | 0,04 |
| 7.723 | Air Liquide SA | 974.643 | 0,95 |
| 9.987 | Airbus SE | 1.303.104 | 1,27 |
| 414 | Aker ASA | 22.812 | 0,02 |
| 2.002 | Aker BP ASA | 58.455 | 0,06 |
| 3.144 | Akzo Nobel NV | 284.972 | 0,28 |
| 7.995 | Alcon Inc | 403.068 | 0,39 |
| 5.475 | Alfa Laval AB | 122.917 | 0,12 |
| 7.346 | Allianz SE | 1.604.366 | 1,56 |
| 10.505 | Altice Europe NV | 60.383 | 0,06 |
| 7.358 | Amadeus IT Group SA | 535.662 | 0,52 |
| 6.003 | Amarin Corp Plc ADR | 114.661 | 0,11 |
| 1.299 | ams AG | 46.930 | 0,05 |
| 1.128 | Amundi SA '144A' | 78.847 | 0,08 |
| 1.254 | ANDRITZ AG | 48.154 | 0,05 |
| 14.909 | Anheuser-Busch InBev SA/NV | 1.084.033 | 1,05 |
| 17 | AP Moller - Maersk A/S - Class A | 20.544 | 0,02 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 119 | AP Moller - Maersk A/S - Class B | 153.011 | 0,15 |
| 11.534 | ArcelorMittal SA | 180.415 | 0,18 |
| 7.090 | ASML Holding NV | 1.869.633 | 1,82 |
| 15.473 | Assa Abloy AB | 322.491 | 0,31 |
| 16.754 | Assicurazioni Generali SpA | 308.190 | 0,30 |
| 8.469 | Atlantia SpA | 176.071 | 0,17 |
| 11.600 | Atlas Copco AB | 412.443 | 0,40 |
| 6.905 | Atlas Copco AB | 213.704 | 0,21 |
| 1.140 | Austevoll Seafood ASA | 10.408 | 0,01 |
| 39.049 | AXA SA | 980.520 | 0,95 |
| 1.545 | Axfood AB | 30.643 | 0,03 |
| 733 | Bakkafrost P/F | 48.304 | 0,05 |
| 5.005 | Banca Mediolanum SpA | 44.319 | 0,04 |
| 114.707 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | 571.585 | 0,56 |
| 142.651 | Banco Comercial Portugues SA | 28.930 | 0,03 |
| 285.627 | Banco Santander SA | 1.065.389 | 1,03 |
| 17.137 | Bank of Ireland Group Plc | 83.663 | 0,08 |
| 21.483 | Bankia SA | 40.871 | 0,04 |
| 11.746 | Bankinter SA | 76.725 | 0,07 |
| 15.959 | BASF SE | 1.074.839 | 1,04 |
| 724 | BAWAG Group AG '144A' | 29.394 | 0,03 |
| 16.281 | Bayer AG | 1.185.420 | 1,15 |
| 6.063 | Bayerische Motoren Werke AG | 443.448 | 0,43 |
| 1.808 | Beiersdorf AG | 192.823 | 0,19 |
| 19.908 | BNP Paribas SA | 1.051.740 | 1,02 |
| 4.990 | Boliden AB | 118.012 | 0,11 |
| 16.375 | Bolloré SA | 63.699 | 0,06 |
| 5.323 | Bouygues SA | 201.635 | 0,20 |
| 1.733 | Buzzi Unicem SpA | 38.906 | 0,04 |
| 1.144 | CA Immobilien Anlagen AG | 42.843 | 0,04 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|--|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 65.389 | CaixaBank SA | 182.958 | 0,18 |
| 2.398 | Capgemini SE | 261.142 | 0,25 |
| 1.758 | Carlsberg A/S | 233.809 | 0,23 |
| 10.416 | Carrefour SA | 155.719 | 0,15 |
| 3.824 | Castellum AB | 80.064 | 0,08 |
| 4.987 | Cellnex Telecom SA '144A' | 191.351 | 0,19 |
| 1.800 | Chr Hansen Holding A/S | 127.526 | 0,12 |
| 9.136 | Cie de Saint-Gobain | 333.464 | 0,32 |
| 8.976 | Cie Financiere Richemont SA | 628.086 | 0,61 |
| 3.103 | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | 338.537 | 0,33 |
| 2.534 | CNP Assurances | 44.928 | 0,04 |
| 2.260 | Coloplast A/S | 249.944 | 0,24 |
| 822 | Colruyt SA | 38.207 | 0,04 |
| 18.418 | Commerzbank AG | 101.612 | 0,10 |
| 1.508 | Continental AG | 173.812 | 0,17 |
| 2.832 | Covestro AG '144A' | 117.386 | 0,11 |
| 23.132 | Credit Agricole SA | 298.981 | 0,29 |
| 40.416 | Credit Suisse Group AG | 487.270 | 0,47 |
| 13.701 | CRH Plc | 488.715 | 0,47 |
| 13.689 | Daimler AG | 675.826 | 0,66 |
| 10.571 | Danone SA | 781.197 | 0,76 |
| 10.509 | Danske Bank A/S | 151.609 | 0,15 |
| 2.329 | Dassault Systemes SE | 341.315 | 0,33 |
| 10.530 | Davide Campari-Milano SpA | 85.714 | 0,08 |
| 1.894 | Demant A/S | 53.178 | 0,05 |
| 32.738 | Deutsche Bank AG | 226.449 | 0,22 |
| 3.070 | Deutsche Boerse AG | 430.261 | 0,42 |
| 8.753 | Deutsche Lufthansa AG | 143.637 | 0,14 |
| 16.980 | Deutsche Post AG | 577.490 | 0,56 |
| 56.217 | Deutsche Telekom AG | 819.082 | 0,80 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 5.925 | Deutsche Wohnen SE | 215.789 | 0,21 |
| 446 | DiaSorin SpA | 51.468 | 0,05 |
| 17.603 | DNB ASA | 292.683 | 0,28 |
| 4.005 | DSV PANALPINA A/S | 411.523 | 0,40 |
| 36.673 | E.ON SE | 349.274 | 0,34 |
| 38.489 | EDP - Energias de Portugal SA | 148.722 | 0,14 |
| 15.166 | Electricite de France SA | 150.568 | 0,15 |
| 4.632 | Electrolux AB | 101.346 | 0,10 |
| 5.951 | Elekta AB | 69.860 | 0,07 |
| 2.644 | Elisa Oyj | 130.217 | 0,13 |
| 5.808 | Endesa SA | 138.172 | 0,13 |
| 134.353 | Enel SpA | 950.144 | 0,92 |
| 31.737 | Engie SA | 457.013 | 0,44 |
| 43.028 | Eni SpA | 595.766 | 0,58 |
| 2.218 | Entra ASA '144A' | 32.606 | 0,03 |
| 18.201 | Epiroc AB | 198.075 | 0,19 |
| 2.350 | Epiroc AB | 24.836 | 0,02 |
| 18.149 | Equinor ASA | 322.922 | 0,31 |
| 6.252 | Erste Group Bank AG | 209.817 | 0,20 |
| 4.990 | EssilorLuxottica SA | 677.642 | 0,66 |
| 10.227 | Essity AB | 293.742 | 0,29 |
| 3.100 | Evonik Industries AG | 84.351 | 0,08 |
| 2.101 | EXOR NV | 145.137 | 0,14 |
| 4.585 | Fabege AB | 67.940 | 0,07 |
| 1.709 | Fastighets AB Balder - Class B | 70.458 | 0,07 |
| 2.110 | Ferrari NV | 312.069 | 0,30 |
| 7.716 | Ferrovial SA | 208.101 | 0,20 |
| 10.210 | FinecoBank Banca Fineco SpA | 109.145 | 0,11 |
| 1.402 | Flutter Entertainment Plc | 151.907 | 0,15 |
| 7.776 | Fortum Oyj | 171.072 | 0,17 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|-------------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 3.610 | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | 238.116 | 0,23 |
| 7.097 | Fresenius SE & Co KGaA | 356.127 | 0,35 |
| 778 | Galapagos NV | 145.097 | 0,14 |
| 8.962 | Galp Energia SGPS SA | 133.534 | 0,13 |
| 620 | Geberit AG | 309.836 | 0,30 |
| 1.125 | Genmab A/S | 223.048 | 0,22 |
| 3.702 | Getinge AB | 61.303 | 0,06 |
| 132 | Givaudan SA | 368.078 | 0,36 |
| 3.449 | Gjensidige Forsikring ASA | 64.427 | 0,06 |
| 201.880 | Glencore Plc | 560.742 | 0,54 |
| 5.264 | Grifols SA | 165.448 | 0,16 |
| 3.942 | Grifols SA - Preference | 81.994 | 0,08 |
| 1.423 | Groupe Bruxelles Lambert SA | 133.705 | 0,13 |
| 1.130 | H Lundbeck A/S | 38.472 | 0,04 |
| 1.358 | HAL Trust | 195.552 | 0,19 |
| 1.108 | Hannover Rueck SE | 190.908 | 0,19 |
| 2.727 | HeidelbergCement AG | 177.146 | 0,17 |
| 1.585 | Heineken Holding NV | 136.944 | 0,13 |
| 3.153 | Heineken NV | 299.283 | 0,29 |
| 1.705 | Henkel AG & Co KGaA | 143.220 | 0,14 |
| 3.041 | Henkel AG & Co KGaA - Preference | 280.380 | 0,27 |
| 13.472 | Hennes & Mauritz AB | 244.220 | 0,24 |
| 11.855 | Hera SpA | 46.235 | 0,04 |
| 535 | Hermes International | 356.417 | 0,35 |
| 4.970 | Hexagon AB | 248.322 | 0,24 |
| 644 | HOCHTIEF AG | 73.223 | 0,07 |
| 1.616 | Huhtamaki Oyj | 66.870 | 0,06 |
| 5.934 | Husqvarna AB | 42.367 | 0,04 |
| 107.466 | Iberdrola SA | 986.538 | 0,96 |
| 1.510 | ICA Gruppen AB | 62.828 | 0,06 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|---|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 976 | ICON Plc | 149.755 | 0,15 |
| 1.486 | IMMOFINANZ AG | 35.515 | 0,03 |
| 19.139 | Industria de Diseno Textil SA | 601.922 | 0,58 |
| 996 | Industrivarden AB | 21.413 | 0,02 |
| 3.477 | Industrivarden AB - Class A | 76.770 | 0,07 |
| 21.561 | Infineon Technologies AG | 437.904 | 0,43 |
| 3.635 | Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A' | 31.734 | 0,03 |
| 67.641 | ING Groep NV | 722.947 | 0,70 |
| 258.093 | Intesa Sanpaolo SpA | 606.131 | 0,59 |
| 1.814 | Investment AB Latour | 26.379 | 0,03 |
| 8.631 | Investor AB | 419.905 | 0,41 |
| 1.250 | Investor AB | 60.254 | 0,06 |
| 3.381 | ISS A/S | 72.327 | 0,07 |
| 8.088 | James Hardie Industries Plc CDI | 141.165 | 0,14 |
| 5.063 | Jeronimo Martins SGPS SA | 74.249 | 0,07 |
| 3.968 | KBC Group NV | 266.094 | 0,26 |
| 1.305 | Kering SA | 763.686 | 0,74 |
| 2.391 | Kerry Group Plc | 265.640 | 0,26 |
| 1.212 | Kesko Oyj | 76.453 | 0,07 |
| 2.439 | Kingspan Group Plc | 132.804 | 0,13 |
| 4.059 | Kinnevik AB | 88.461 | 0,09 |
| 4.255 | Klepierre SA (REIT) | 144.032 | 0,14 |
| 739 | Knorr-Bremse AG | 67.064 | 0,07 |
| 6.029 | Kone Oyj - Class B | 351.370 | 0,34 |
| 1.886 | Kongsberg Gruppen ASA | 26.387 | 0,03 |
| 17.003 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | 379.082 | 0,37 |
| 2.947 | Koninklijke DSM NV | 342.147 | 0,33 |
| 65.001 | Koninklijke KPN NV | 171.018 | 0,17 |
| 15.568 | Koninklijke Philips NV | 677.519 | 0,66 |
| 1.017 | Kuehne + Nagel International AG | 152.694 | 0,15 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|---|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 821 | L E Lundbergforetagen AB | 32.113 | 0,03 |
| 8.698 | LafargeHolcim Ltd | 429.708 | 0,42 |
| 4.391 | Legrand SA | 318.962 | 0,31 |
| 7.388 | Leonardo SpA | 77.205 | 0,07 |
| 5.116 | Leroy Seafood Group ASA | 30.239 | 0,03 |
| 1.284 | Lonza Group AG | 417.220 | 0,41 |
| 4.277 | L'Oreal SA | 1.129.128 | 1,10 |
| 3.189 | Lundin Petroleum AB | 96.603 | 0,09 |
| 4.512 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 1.868.870 | 1,81 |
| 17.628 | Mapfre SA | 41.602 | 0,04 |
| 6.320 | Mediaset SpA | 16.811 | 0,02 |
| 12.860 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | 126.208 | 0,12 |
| 2.007 | Merck KGaA | 211.437 | 0,21 |
| 2.307 | Metso Oyj | 81.160 | 0,08 |
| 1.744 | Millicom International Cellular SA SDR | 74.457 | 0,07 |
| 3.277 | Moncler SpA | 131.309 | 0,13 |
| 8.182 | Mowi ASA | 189.296 | 0,18 |
| 953 | MTU Aero Engines AG | 242.634 | 0,24 |
| 2.504 | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 658.552 | 0,64 |
| 17.208 | Natixis SA | 68.109 | 0,07 |
| 9.342 | Naturgy Energy Group SA | 209.261 | 0,20 |
| 7.256 | Neste Oyj | 225.081 | 0,22 |
| 51.236 | Nestle SA | 4.938.935 | 4,80 |
| 3.103 | Nexi SpA '144A' | 38.415 | 0,04 |
| 7.817 | Nibe Industrier AB | 120.816 | 0,12 |
| 5.354 | NN Group NV | 181.072 | 0,18 |
| 95.843 | Nokia Oyj | 315.899 | 0,31 |
| 51.557 | Nordea Bank Abp | 373.273 | 0,36 |
| 24.354 | Norsk Hydro ASA | 80.591 | 0,08 |
| 4.246 | NOS SGPS SA | 20.381 | 0,02 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|---|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 40.300 | Novartis AG | 3.407.221 | 3,31 |
| 29.394 | Novo Nordisk A/S | 1.520.969 | 1,48 |
| 3.755 | Novozymes A/S | 163.822 | 0,16 |
| 4.802 | NXP Semiconductors NV | 544.422 | 0,53 |
| 4.128 | OMV AG | 206.730 | 0,20 |
| 35.580 | Orange SA | 466.810 | 0,45 |
| 1.704 | Orion Oyj | 70.324 | 0,07 |
| 13.632 | Orkla ASA | 122.948 | 0,12 |
| 2.757 | Orsted A/S '144A' | 254.214 | 0,25 |
| 324 | Partners Group Holding AG | 264.511 | 0,26 |
| 2.988 | Pernod Ricard SA | 476.287 | 0,46 |
| 9.557 | Peugeot SA | 203.564 | 0,20 |
| 7.987 | Pirelli & C SpA '144A' | 41.053 | 0,04 |
| 2.832 | Porsche Automobil Holding SE - Preference | 188.724 | 0,18 |
| 8.594 | Poste Italiane SpA '144A' | 86.971 | 0,08 |
| 9.400 | PRADA SpA | 34.607 | 0,03 |
| 7.066 | Prosus NV | 470.101 | 0,46 |
| 2.614 | Proximus SADP | 66.709 | 0,06 |
| 4.672 | Prysmian SpA | 100.401 | 0,10 |
| 3.822 | Publicis Groupe SA | 154.256 | 0,15 |
| 2.508 | Raiffeisen Bank International AG | 56.154 | 0,05 |
| 2.191 | Randstad NV | 119.278 | 0,12 |
| 1.738 | Recordati SpA | 65.297 | 0,06 |
| 7.830 | Red Electrica Corp SA | 140.353 | 0,14 |
| 3.519 | Renault SA | 148.431 | 0,14 |
| 24.184 | Repsol SA | 336.883 | 0,33 |
| 11.939 | Roche Holding AG | 3.448.874 | 3,35 |
| 571 | Roche Holding AG | 161.585 | 0,16 |
| 583 | RTL Group SA | 25.640 | 0,02 |
| 10.055 | RWE AG | 275.004 | 0,27 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 17.187 | Ryanair Holdings Plc | 251.446 | 0,24 |
| 1.546 | Saab AB | 46.170 | 0,04 |
| 6.782 | Safran SA | 933.542 | 0,91 |
| 10.432 | Saipem SpA | 45.442 | 0,04 |
| 944 | Salmar ASA | 43.001 | 0,04 |
| 7.751 | Sampo Oyj - Class A | 301.591 | 0,29 |
| 18.889 | Sandvik AB | 328.343 | 0,32 |
| 18.579 | Sanofi | 1.665.050 | 1,62 |
| 17.289 | SAP SE | 2.080.212 | 2,02 |
| 630 | Sartorius AG - Preference | 120.204 | 0,12 |
| 1.016 | Schibsted ASA | 27.327 | 0,03 |
| 2.062 | Schibsted ASA - Class B | 52.639 | 0,05 |
| 386 | Schindler Holding AG | 84.233 | 0,08 |
| 715 | Schindler Holding AG | 161.947 | 0,16 |
| 9.480 | Schneider Electric SE | 867.420 | 0,84 |
| 5.598 | Securitas AB | 86.014 | 0,08 |
| 92 | SGS SA | 224.376 | 0,22 |
| 14.071 | Siemens AG | 1.639.834 | 1,59 |
| 4.074 | Siemens Gamesa Renewable Energy SA | 63.697 | 0,06 |
| 2.779 | Siemens Healthineers AG '144A' | 118.997 | 0,12 |
| 2.296 | Sika AG | 384.118 | 0,37 |
| 29.669 | Skandinaviska Enskilda Banken AB | 248.702 | 0,24 |
| 7.051 | Skanska AB | 142.060 | 0,14 |
| 7.657 | SKF AB | 138.019 | 0,13 |
| 4.348 | Smurfit Kappa Group Plc | 148.962 | 0,14 |
| 37.730 | Snam SpA | 176.803 | 0,17 |
| 13.636 | Societe Generale SA | 422.921 | 0,41 |
| 1.531 | Sodexo SA | 161.750 | 0,16 |
| 273 | Sofina SA | 52.580 | 0,05 |
| 1.241 | Solvay SA | 128.195 | 0,12 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|---|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 3.118 | SpareBank 1 SR-Bank ASA | 31.611 | 0,03 |
| 4.929 | SSAB AB - Class A | 15.410 | 0,01 |
| 2.919 | SSAB AB - Class B | 8.478 | 0,01 |
| 10.712 | STMicroelectronics NV | 256.767 | 0,25 |
| 10.204 | Stora Enso Oyj | 132.295 | 0,13 |
| 8.569 | Storebrand ASA | 59.961 | 0,06 |
| 11.181 | Svenska Cellulosa AB SCA - Class B | 101.089 | 0,10 |
| 26.287 | Svenska Handelsbanken AB | 252.424 | 0,25 |
| 577 | Swatch Group AG/The | 27.152 | 0,03 |
| 509 | Swatch Group AG/The | 126.433 | 0,12 |
| 18.150 | Swedbank AB | 240.876 | 0,23 |
| 3.164 | Swedish Match AB | 145.379 | 0,14 |
| 2.911 | Swedish Orphan Biovitrum AB | 42.803 | 0,04 |
| 4.864 | Swiss Re AG | 486.410 | 0,47 |
| 464 | Swisscom AG | 218.815 | 0,21 |
| 2.357 | Symrise AG - Class A | 221.087 | 0,21 |
| 898 | Talanx AG | 39.674 | 0,04 |
| 8.240 | Tele2 AB | 106.533 | 0,10 |
| 183.383 | Telecom Italia SpA/Milano | 102.034 | 0,10 |
| 110.680 | Telecom Italia SpA/Milano | 60.409 | 0,06 |
| 52.899 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B | 410.604 | 0,40 |
| 14.089 | Telefonica Deutschland Holding AG | 36.406 | 0,04 |
| 84.385 | Telefonica SA | 525.465 | 0,51 |
| 1.677 | Telekom Austria AG - Class A | 12.209 | 0,01 |
| 887 | Telenet Group Holding NV | 35.533 | 0,03 |
| 11.063 | Telenor ASA | 176.597 | 0,17 |
| 37.093 | Telia Co AB | 142.088 | 0,14 |
| 8.453 | Tenaris SA | 84.953 | 0,08 |
| 25.926 | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | 154.363 | 0,15 |
| 1.876 | TGS NOPEC Geophysical Co ASA | 50.801 | 0,05 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.942 | Thales SA | 179.674 | 0,17 |
| 9.099 | thyssenkrupp AG | 109.552 | 0,11 |
| 2.019 | Tomra Systems ASA | 56.987 | 0,06 |
| 45.743 | TOTAL SA | 2.250.556 | 2,19 |
| 4.494 | Trelleborg AB | 72.088 | 0,07 |
| 2.152 | Tryg A/S | 56.879 | 0,06 |
| 62.198 | UBS Group AG | 699.528 | 0,68 |
| 2.212 | UCB SA | 156.831 | 0,15 |
| 3.623 | Umicore SA | 157.093 | 0,15 |
| 2.436 | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | 342.623 | 0,33 |
| 36.123 | UniCredit SpA | 470.321 | 0,46 |
| 24.604 | Unilever NV | 1.260.463 | 1,22 |
| 12.245 | UnipolSai Assicurazioni SpA | 31.715 | 0,03 |
| 7.958 | UPM-Kymmene Oyj | 245.982 | 0,24 |
| 1.220 | Verbund AG | 54.583 | 0,05 |
| 3.358 | Vestas Wind Systems A/S | 302.530 | 0,29 |
| 828 | Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe | 21.031 | 0,02 |
| 9.832 | Vinci SA | 973.368 | 0,95 |
| 13.026 | Vivendi SA | 336.331 | 0,33 |
| 2.071 | voestalpine AG | 51.485 | 0,05 |
| 4.001 | Volvo AB | 60.238 | 0,06 |
| 24.812 | Volvo AB | 370.496 | 0,36 |
| 9.545 | Vonovia SE | 458.160 | 0,44 |
| 9.747 | Wartsila OYJ Abp | 96.008 | 0,09 |
| 1.985 | Wirecard AG | 213.388 | 0,21 |
| 4.732 | Wolters Kluwer NV | 307.675 | 0,30 |
| 3.225 | Yara International ASA | 119.406 | 0,12 |
| 2.356 | Zalando SE '144A' | 106.444 | 0,10 |
| 2.571 | Zurich Insurance Group AG | 939.251 | 0,91 |
| Stammaktien insgesamt | | 102.876.109 | 99,90 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Gesamtanlagen | Wert € | % des Nettover- mögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| Stammaktien | 102.876.109 | 99,90 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 104.343 | 0,10 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 102.980.452 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | % des Gesamt- vermö- gens |
|--|------------------------------------|
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | 99,89 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0,11 |
| | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | |

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) | | | |
| 13.522 | a2 Milk Co Ltd | 137.023 | 0,38 |
| 3.448 | Afterpay Ltd | 70.968 | 0,20 |
| 11.635 | AGL Energy Ltd | 167.912 | 0,46 |
| 243.495 | AIA Group Ltd | 2.556.260 | 7,07 |
| 4.367 | Air New Zealand Ltd | 8.632 | 0,02 |
| 83.805 | Alibaba Health Information Technology Ltd | 96.800 | 0,27 |
| 54.711 | Alumina Ltd | 88.456 | 0,24 |
| 68.275 | AMP Ltd | 91.909 | 0,25 |
| 20.874 | APA Group | 162.875 | 0,45 |
| 12.481 | Aristocrat Leisure Ltd | 295.406 | 0,82 |
| 68.013 | Ascendas Real Estate Investment Trust (Units) (REIT) | 150.226 | 0,42 |
| 5.580 | ASM Pacific Technology Ltd | 77.414 | 0,21 |
| 3.504 | ASX Ltd | 193.135 | 0,53 |
| 23.543 | Auckland International Airport Ltd | 138.980 | 0,38 |
| 34.443 | Aurizon Holdings Ltd | 126.628 | 0,35 |
| 57.594 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | 997.167 | 2,76 |
| 35.392 | Bank of East Asia Ltd/The | 79.034 | 0,22 |
| 58.225 | BHP Group Ltd | 1.592.974 | 4,40 |
| 9.037 | BlueScope Steel Ltd | 95.670 | 0,26 |
| 20.755 | Boral Ltd | 65.362 | 0,18 |
| 33.508 | Brambles Ltd | 276.059 | 0,76 |
| 4.775 | Caltex Australia Ltd | 113.957 | 0,31 |
| 43.214 | CapitalLand Commercial Trust (Units) (REIT) | 63.955 | 0,18 |
| 46.331 | CapitalLand Ltd | 129.211 | 0,36 |
| 49.586 | CapitalLand Mall Trust (Units) (REIT) | 90.718 | 0,25 |
| 5.000 | Cathay Pacific Airways Ltd | 7.392 | 0,02 |
| 10.488 | Challenger Ltd | 59.644 | 0,16 |
| 44.971 | China Gas Holdings Ltd | 168.530 | 0,47 |
| 17.285 | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd | 16.527 | 0,05 |
| 1.260 | CIMIC Group Ltd | 29.353 | 0,08 |

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 13.076 | City Developments Ltd | 106.484 | 0,29 |
| 46.542 | CK Asset Holdings Ltd | 335.992 | 0,93 |
| 56.759 | CK Hutchison Holdings Ltd | 541.234 | 1,50 |
| 14.808 | CK Infrastructure Holdings Ltd | 105.380 | 0,29 |
| 37.407 | CLP Holdings Ltd | 393.186 | 1,09 |
| 13.052 | Coca-Cola Amatil Ltd | 101.475 | 0,28 |
| 1.071 | Cochlear Ltd | 169.191 | 0,47 |
| 25.063 | Coles Group Ltd | 261.453 | 0,72 |
| 36.029 | ComfortDelGro Corp Ltd | 63.771 | 0,18 |
| 35.472 | Commonwealth Bank of Australia | 1.992.318 | 5,51 |
| 9.306 | Computershare Ltd | 109.769 | 0,30 |
| 12.096 | Contact Energy Ltd | 58.185 | 0,16 |
| 4.495 | Crown Resorts Ltd | 37.949 | 0,10 |
| 8.911 | CSL Ltd | 1.727.364 | 4,78 |
| 88.191 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd | 210.296 | 0,58 |
| 4.186 | Dairy Farm International Holdings Ltd | 23.902 | 0,07 |
| 36.096 | DBS Group Holdings Ltd | 694.737 | 1,92 |
| 20.229 | Dexus (Units) (REIT) | 166.374 | 0,46 |
| 10.587 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | 158.565 | 0,44 |
| 12.089 | Fletcher Building Ltd | 41.514 | 0,11 |
| 27.315 | Fortescue Metals Group Ltd | 205.260 | 0,57 |
| 36.994 | Fosun International Ltd | 53.935 | 0,15 |
| 37.357 | Galaxy Entertainment Group Ltd | 275.198 | 0,76 |
| 107.623 | Geely Automobile Holdings Ltd | 210.500 | 0,58 |
| 12.510 | Genesis Energy Ltd | 25.531 | 0,07 |
| 162.245 | Genting Singapore Ltd | 111.008 | 0,31 |
| 35.137 | Goodman Group (REIT) | 330.234 | 0,91 |
| 35.304 | GPT Group/The (REIT) | 138.976 | 0,38 |
| 17.663 | Haier Electronics Group Co Ltd | 55.198 | 0,15 |
| 45.839 | Hang Lung Properties Ltd | 100.599 | 0,28 |

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 13.339 | Hang Seng Bank Ltd | 275.620 | 0,76 |
| 28.136 | Henderson Land Development Co Ltd | 138.120 | 0,38 |
| 29.199 | HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd | 28.780 | 0,08 |
| 53.342 | HKT Trust & HKT Ltd | 75.168 | 0,21 |
| 206.951 | Hong Kong & China Gas Co Ltd | 404.244 | 1,12 |
| 24.215 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 786.261 | 2,17 |
| 22.653 | Hongkong Land Holdings Ltd | 130.255 | 0,36 |
| 14.485 | Infratil Ltd | 49.253 | 0,14 |
| 50.268 | Insurance Australia Group Ltd | 270.674 | 0,75 |
| 1.420 | Jardine Cycle & Carriage Ltd | 31.787 | 0,09 |
| 4.684 | Jardine Matheson Holdings Ltd | 260.430 | 0,72 |
| 3.337 | Jardine Strategic Holdings Ltd | 102.279 | 0,28 |
| 25.756 | Keppel Corp Ltd | 129.677 | 0,36 |
| 8.732 | Kerry Properties Ltd | 27.736 | 0,08 |
| 10.386 | Lendlease Group | 128.495 | 0,36 |
| 44.729 | Link REIT (Units) (REIT) | 473.593 | 1,31 |
| 6.902 | Macquarie Group Ltd | 668.818 | 1,85 |
| 2.282 | Magellan Financial Group Ltd | 91.356 | 0,25 |
| 1.338 | Mainfreight Ltd | 38.364 | 0,11 |
| 32.665 | Mapletree Commercial Trust (REIT) | 58.060 | 0,16 |
| 30.955 | Mapletree Industrial Trust (Units) (REIT) | 59.855 | 0,17 |
| 47.883 | Mapletree Logistics Trust (Units) (REIT) | 61.962 | 0,17 |
| 48.093 | Medibank Pvt Ltd | 106.831 | 0,30 |
| 8.432 | Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR | 203.801 | 0,56 |
| 8.251 | Mercury NZ Ltd | 28.111 | 0,08 |
| 24.053 | Meridian Energy Ltd | 81.137 | 0,22 |
| 11.139 | MGM China Holdings Ltd | 18.184 | 0,05 |
| 72.312 | Mirvac Group (Units) (REIT) | 161.646 | 0,45 |
| 28.862 | MTR Corp Ltd | 170.576 | 0,47 |
| 59.157 | National Australia Bank Ltd | 1.024.228 | 2,83 |

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 109.429 | New World Development Co Ltd | 149.991 | 0,41 |
| 16.283 | Newcrest Mining Ltd | 346.247 | 0,96 |
| 19.677 | NWS Holdings Ltd | 27.577 | 0,08 |
| 24.985 | Oil Search Ltd | 127.334 | 0,35 |
| 6.916 | Orica Ltd | 106.859 | 0,30 |
| 32.628 | Origin Energy Ltd | 193.809 | 0,54 |
| 73.937 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | 603.755 | 1,67 |
| 30.182 | Power Assets Holdings Ltd | 220.793 | 0,61 |
| 30.331 | Qantas Airways Ltd | 151.594 | 0,42 |
| 29.018 | QBE Insurance Group Ltd | 262.730 | 0,73 |
| 3.011 | Ramsay Health Care Ltd | 153.516 | 0,42 |
| 824 | REA Group Ltd | 60.009 | 0,17 |
| 7.440 | Rio Tinto Ltd | 525.089 | 1,45 |
| 6.834 | Ryman Healthcare Ltd | 75.291 | 0,21 |
| 45.553 | Sands China Ltd | 243.497 | 0,67 |
| 34.330 | Santos Ltd | 197.403 | 0,55 |
| 11.091 | SATS Ltd | 41.737 | 0,12 |
| 95.566 | Scentre Group (REIT) | 257.293 | 0,71 |
| 16.807 | Sembcorp Industries Ltd | 28.624 | 0,08 |
| 24.764 | Shimao Property Holdings Ltd | 95.982 | 0,27 |
| 14.092 | Singapore Airlines Ltd | 94.741 | 0,26 |
| 17.945 | Singapore Exchange Ltd | 118.243 | 0,33 |
| 27.924 | Singapore Press Holdings Ltd | 45.272 | 0,12 |
| 29.774 | Singapore Technologies Engineering Ltd | 87.243 | 0,24 |
| 145.575 | Singapore Telecommunications Ltd | 364.849 | 1,01 |
| 116.567 | Sino Biopharmaceutical Ltd | 163.066 | 0,45 |
| 67.832 | Sino Land Co Ltd | 98.547 | 0,27 |
| 26.671 | SJM Holdings Ltd | 30.362 | 0,08 |
| 8.370 | SKYCITY Entertainment Group Ltd | 22.418 | 0,06 |
| 7.910 | Sonic Healthcare Ltd | 159.860 | 0,44 |

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 88.665 | South32 Ltd | 168.284 | 0,47 |
| 33.831 | Spark New Zealand Ltd | 98.829 | 0,27 |
| 41.723 | Stockland (REIT) | 135.501 | 0,37 |
| 26.963 | Sun Art Retail Group Ltd | 32.701 | 0,09 |
| 30.591 | Sun Hung Kai Properties Ltd | 468.377 | 1,29 |
| 27.307 | Suncorp Group Ltd | 248.774 | 0,69 |
| 23.191 | Suntec Real Estate Investment Trust (Units) (REIT) | 31.735 | 0,09 |
| 9.590 | Swire Pacific Ltd | 89.108 | 0,25 |
| 15.550 | Swire Pacific Ltd | 23.270 | 0,06 |
| 15.005 | Swire Properties Ltd | 49.780 | 0,14 |
| 41.107 | Sydney Airport | 250.242 | 0,69 |
| 35.745 | Tabcorp Holdings Ltd | 113.826 | 0,31 |
| 26.077 | Techtronic Industries Co Ltd | 212.684 | 0,59 |
| 245.564 | Telstra Corp Ltd | 611.075 | 1,69 |
| 52.253 | Transurban Group | 547.665 | 1,51 |
| 13.052 | Treasury Wine Estates Ltd | 149.001 | 0,41 |
| 28.832 | United Overseas Bank Ltd | 566.292 | 1,57 |
| 7.480 | UOL Group Ltd | 46.283 | 0,13 |
| 6.980 | Venture Corp Ltd | 84.094 | 0,23 |
| 54.938 | Vicinity Centres (REIT) | 96.161 | 0,27 |
| 24.331 | Wesfarmers Ltd | 708.087 | 1,96 |
| 70.628 | Westpac Banking Corp | 1.202.975 | 3,33 |
| 159.265 | WH Group Ltd '144A' | 164.542 | 0,45 |
| 15.849 | Wharf Holdings Ltd/The | 40.315 | 0,11 |
| 22.228 | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | 135.648 | 0,37 |
| 20.920 | Wheelock & Co Ltd | 139.479 | 0,39 |
| 38.592 | Wilmar International Ltd | 118.247 | 0,33 |
| 2.408 | WiseTech Global Ltd | 39.559 | 0,11 |
| 19.652 | Woodside Petroleum Ltd | 474.940 | 1,31 |
| 26.631 | Woolworths Group Ltd | 676.928 | 1,87 |

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|---------------------------------------|-------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung) | | | |
| 39.463 | Wynn Macau Ltd | 97.242 | 0,27 |
| 1.837 | Xero Ltd | 103.306 | 0,29 |
| 44.437 | Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd | 37.014 | 0,10 |
| Stammaktien insgesamt | | 36.054.751 | 99,68 |
| Gesamtanlagen | | | |
| Stammaktien | | 36.054.751 | 99,68 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | 113.997 | 0,32 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 36.168.748 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | |
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 99,68 | 99,68 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 0,32 | 0,32 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

L&G Clean Water UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) | | | |
| 1.603 | Advanced Drainage Systems Inc | 62.261 | 2,22 |
| 2.512 | Alfa Laval AB | 63.303 | 2,25 |
| 426 | American Water Works Co Inc | 52.334 | 1,86 |
| 1.028 | AO Smith Corp | 48.974 | 1,74 |
| 1.185 | Aqua America Inc | 55.624 | 1,98 |
| 2.568 | AquaVenture Holdings Ltd | 69.644 | 2,48 |
| 955 | Badger Meter Inc | 62.008 | 2,21 |
| 90.966 | Beijing Enterprises Water Group Ltd | 45.998 | 1,64 |
| 4.306 | Cadiz Inc | 47.452 | 1,69 |
| 954 | California Water Service Group | 49.188 | 1,75 |
| 64.416 | China Water Affairs Group Ltd | 48.198 | 1,72 |
| 4.161 | Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR | 62.623 | 2,23 |
| 622 | Crane Co | 53.728 | 1,91 |
| 366 | Danaher Corp | 56.174 | 2,00 |
| 260 | Ecolab Inc | 50.177 | 1,79 |
| 5.127 | Energy Recovery Inc | 50.193 | 1,79 |
| 3.063 | Evoqua Water Technologies Corp | 58.044 | 2,07 |
| 1.019 | Franklin Electric Co Inc | 58.409 | 2,08 |
| 24.870 | Guangdong Investment Ltd | 52.027 | 1,85 |
| 2.094 | Halma Plc | 58.698 | 2,09 |
| 1.307 | HD Supply Holdings Inc | 52.568 | 1,87 |
| 303 | IDEX Corp | 52.116 | 1,85 |
| 195 | IDEXX Laboratories Inc | 50.920 | 1,81 |
| 692 | Itron Inc | 58.093 | 2,07 |
| 567 | Kadant Inc | 59.728 | 2,13 |
| 1.898 | Kurita Water Industries Ltd | 56.848 | 2,02 |
| 803 | LANXESS AG | 53.919 | 1,92 |
| 549 | Lindsay Corp | 52.699 | 1,88 |
| 790 | METAWATER Co Ltd | 31.767 | 1,13 |
| 73 | Mettler-Toledo International Inc | 57.910 | 2,06 |
| 834 | Middlesex Water Co | 53.017 | 1,89 |

L&G Clean Water UCITS ETF

Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung) | | | |
| 4.672 | Mueller Water Products Inc - Class A | 55.971 | 1,99 |
| 2.264 | National Oilwell Varco Inc | 56.713 | 2,02 |
| 633 | Organo Corp | 39.200 | 1,40 |
| 8.104 | Outotec Oyj | 52.378 | 1,86 |
| 1.364 | Pentair Plc | 62.567 | 2,23 |
| 1.794 | Rexnord Corp | 58.520 | 2,08 |
| 310 | Rockwell Automation Inc | 62.828 | 2,24 |
| 144 | Roper Technologies Inc | 51.009 | 1,82 |
| 12.874 | Rotork Plc | 57.134 | 2,03 |
| 3.219 | Sekisui Chemical Co Ltd | 56.397 | 2,01 |
| 2.027 | Severn Trent Plc | 67.535 | 2,40 |
| 752 | SJW Group | 53.437 | 1,90 |
| 1.193 | SPX FLOW Inc | 58.302 | 2,07 |
| 505 | Sulzer AG | 56.321 | 2,00 |
| 617 | Tetra Tech Inc | 53.161 | 1,89 |
| 1.289 | Trimble Inc | 53.738 | 1,91 |
| 5.280 | United Utilities Group Plc | 65.988 | 2,35 |
| 223 | Waters Corp | 52.104 | 1,85 |
| 520 | Watts Water Technologies Inc - Class A | 51.875 | 1,85 |
| 657 | Xylem Inc/NY | 51.765 | 1,84 |
| | Stammaktien insgesamt | 2.801.585 | 99,72 |
| Gesamtanlagen | | | |
| | Stammaktien | 2.801.585 | 99,72 |
| | Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 8.004 | 0,28 |
| | Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 2.809.589 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamtvermögens |
| | Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 99,67 |
| | Sonstige Vermögenswerte | | 0,33 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) | | | |
| 264 | Accenture Plc - Class A | 55.590 | 1,52 |
| 142 | Adobe Inc | 46.833 | 1,28 |
| 254 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | 53.873 | 1,48 |
| 46 | Alphabet Inc - Class A | 61.612 | 1,69 |
| 564 | Alteryx Inc - Class A | 56.439 | 1,55 |
| 415 | Amadeus IT Group SA | 33.912 | 0,93 |
| 35 | Amazon.com Inc | 64.674 | 1,77 |
| 438 | Analog Devices Inc | 52.052 | 1,43 |
| 3.267 | Appen Ltd | 51.580 | 1,41 |
| 295 | Arista Networks Inc | 60.003 | 1,65 |
| 192 | ASML Holding NV NY Reg Shrs | 56.820 | 1,56 |
| 356 | Aspen Technology Inc | 43.051 | 1,18 |
| 299 | Autodesk Inc | 54.855 | 1,50 |
| 526 | Baidu Inc ADR | 66.486 | 1,82 |
| 3.498 | Blue Prism Group plc | 52.503 | 1,44 |
| 23 | Booking Holdings Inc | 47.236 | 1,30 |
| 369 | Capgemini SE | 45.106 | 1,24 |
| 2.839 | Cloudera Inc | 33.018 | 0,91 |
| 902 | Cognex Corp | 50.548 | 1,39 |
| 717 | Cornerstone OnDemand Inc | 41.980 | 1,15 |
| 421 | Electronic Arts Inc | 45.262 | 1,24 |
| 168 | Fair Isaac Corp | 62.946 | 1,73 |
| 316 | Fiserv Inc | 36.539 | 1,00 |
| 5.651 | Global Unichip Corp | 45.431 | 1,25 |
| 1.279 | Grubhub Inc | 62.211 | 1,71 |
| 401 | HubSpot Inc | 63.559 | 1,74 |
| 2.876 | Iflytek Co Ltd 'A' | 14.236 | 0,39 |
| 187 | Illumina Inc | 62.035 | 1,70 |
| 2.148 | Infineon Technologies AG | 48.969 | 1,34 |
| 1.807 | Intellia Therapeutics Inc | 26.509 | 0,73 |
| 458 | International Business Machines Corp | 61.390 | 1,68 |

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung) | | | |
| 198 | Intuit Inc | 51.862 | 1,42 |
| 1.345 | iRobot Corp | 68.097 | 1,87 |
| 1.247 | JD.com Inc ADR | 43.932 | 1,20 |
| 172 | Lam Research Corp | 50.293 | 1,38 |
| 75 | MercadoLibre Inc | 42.896 | 1,18 |
| 402 | Microsoft Corp | 63.395 | 1,74 |
| 254 | MongoDB Inc | 33.429 | 0,92 |
| 175 | Netflix Inc | 56.625 | 1,55 |
| 782 | New Relic Inc | 51.385 | 1,41 |
| 3.408 | Nuance Communications Inc | 60.765 | 1,67 |
| 1.257 | Nutanix Inc | 39.294 | 1,08 |
| 276 | NVIDIA Corp | 64.943 | 1,78 |
| 224 | Palo Alto Networks Inc | 51.800 | 1,42 |
| 377 | Proofpoint Inc | 43.272 | 1,19 |
| 762 | Publicis Groupe SA | 34.521 | 0,95 |
| 2.229 | Pure Storage Inc | 38.138 | 1,05 |
| 1.016 | Rapid7 Inc | 56.916 | 1,56 |
| 5.345 | Sage Group Plc/The | 53.035 | 1,45 |
| 386 | salesforce.com Inc | 62.779 | 1,72 |
| 197 | ServiceNow Inc | 55.617 | 1,53 |
| 127 | Shopify Inc | 50.493 | 1,38 |
| 1.038 | SoftBank Group Corp | 45.427 | 1,25 |
| 412 | Splunk Inc | 61.705 | 1,69 |
| 362 | Spotify Technology SA | 54.137 | 1,48 |
| 753 | Square Inc | 47.108 | 1,29 |
| 3.247 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 35.853 | 0,98 |
| 953 | Talend SA ADR | 37.272 | 1,02 |
| 1.422 | Tencent Holdings Ltd | 68.547 | 1,88 |
| 1.932 | Teradata Corp | 51.720 | 1,42 |
| 680 | Teradyne Inc | 46.369 | 1,27 |

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--|--------------------------------|------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung) | | | |
| 108 | Tesla Inc | 45.180 | 1,24 |
| 441 | Twilio Inc - Class A | 43.341 | 1,19 |
| 702 | Varonis Systems Inc | 54.552 | 1,50 |
| 351 | Veeva Systems Inc - Class A | 49.372 | 1,35 |
| 1.880 | Veracyte Inc | 52.490 | 1,44 |
| 365 | Verisk Analytics Inc - Class A | 54.509 | 1,50 |
| 448 | Wix.com Ltd | 54.826 | 1,50 |
| 624 | Xilinx Inc | 61.008 | 1,67 |
| 1.326 | Yandex NV - Class A | 57.668 | 1,58 |
| 2.537 | Yext Inc | 36.584 | 1,00 |
| 709 | Zendesk Inc | 54.331 | 1,49 |
| Stammaktien insgesamt | | 3.642.744 | 99,90 |
| Gesamtanlagen | | | |
| Stammaktien | | 3.642.744 | 99,90 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | | 3.689 | 0,10 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | | 3.646.433 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamtvermögens |
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | | 99,86 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | 0,14 |
| | | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | | |

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) | | | |
| 2.843 | 3D Systems Corp | 24.876 | 0,92 |
| 296 | Abbott Laboratories | 25.711 | 0,95 |
| 206 | ABIOMED Inc | 35.142 | 1,30 |
| 378 | Agilent Technologies Inc | 32.247 | 1,20 |
| 114 | Align Technology Inc | 31.811 | 1,18 |
| 157 | Alnylam Pharmaceuticals Inc | 18.082 | 0,67 |
| 2.333 | Axogen Inc | 41.737 | 1,55 |
| 297 | Baxter International Inc | 24.835 | 0,92 |
| 82 | Becton Dickinson and Co | 22.302 | 0,83 |
| 331 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 27.986 | 1,04 |
| 89 | Bio-Rad Laboratories Inc | 32.933 | 1,22 |
| 690 | BioTelemetry Inc | 31.947 | 1,19 |
| 882 | Boston Scientific Corp | 39.884 | 1,48 |
| 399 | Bristol-Myers Squibb Co | 25.612 | 0,95 |
| 676 | Brooks Automation Inc | 28.365 | 1,05 |
| 825 | Cardiovascular Systems Inc | 40.087 | 1,49 |
| 650 | Catalent Inc | 36.595 | 1,36 |
| 5.562 | Cerus Corp | 23.472 | 0,87 |
| 266 | Charles River Laboratories International Inc | 40.634 | 1,51 |
| 1.653 | Codexis Inc | 26.431 | 0,98 |
| 211 | CONMED Corp | 23.596 | 0,88 |
| 365 | CRISPR Therapeutics AG | 22.230 | 0,83 |
| 1.309 | CryoLife Inc | 35.461 | 1,32 |
| 152 | CSL Ltd | 29.465 | 1,09 |
| 256 | Danaher Corp | 39.291 | 1,46 |
| 166 | DexCom Inc | 36.311 | 1,35 |
| 273 | DiaSorin SpA | 35.363 | 1,31 |
| 629 | Editas Medicine Inc | 18.625 | 0,69 |
| 136 | Edwards Lifesciences Corp | 31.727 | 1,18 |
| 1.425 | EMIS Group Plc | 20.916 | 0,78 |
| 56 | Eurofins Scientific SE | 31.065 | 1,15 |

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung) | | | |
| 415 | Exact Sciences Corp | 38.379 | 1,42 |
| 8.464 | Fluidigm Corp | 29.455 | 1,09 |
| 649 | Glaukos Corp | 35.351 | 1,31 |
| 357 | Globus Medical Inc | 21.020 | 0,78 |
| 485 | GN Store Nord A/S | 22.826 | 0,85 |
| 810 | Grifols SA | 28.576 | 1,06 |
| 1.002 | HMS Holdings Corp | 29.659 | 1,10 |
| 560 | Hologic Inc | 29.238 | 1,09 |
| 138 | ICON Plc | 23.768 | 0,88 |
| 119 | Illumina Inc | 39.477 | 1,46 |
| 379 | Incyte Corp | 33.094 | 1,23 |
| 194 | Insulet Corp | 33.213 | 1,23 |
| 625 | Integra LifeSciences Holdings Corp | 36.425 | 1,35 |
| 1.546 | Intellia Therapeutics Inc | 22.680 | 0,84 |
| 66 | Intuitive Surgical Inc | 39.016 | 1,45 |
| 1.671 | Invitae Corp | 26.953 | 1,00 |
| 238 | IQVIA Holdings Inc | 36.773 | 1,36 |
| 510 | iRhythm Technologies Inc | 34.726 | 1,29 |
| 702 | Koninklijke Philips NV | 34.293 | 1,27 |
| 99 | Lonza Group AG | 36.109 | 1,34 |
| 184 | Masimo Corp | 29.083 | 1,08 |
| 1.568 | Materialise NV ADR | 28.710 | 1,07 |
| 388 | Medpace Holdings Inc | 32.615 | 1,21 |
| 1.276 | Myriad Genetics Inc | 34.745 | 1,29 |
| 1.119 | NanoString Technologies Inc | 31.131 | 1,16 |
| 1.059 | Natera Inc | 35.678 | 1,32 |
| 1.335 | NeoGenomics Inc | 39.049 | 1,45 |
| 289 | Nevro Corp | 33.969 | 1,26 |
| 242 | Novanta Inc | 21.402 | 0,79 |
| 234 | Novocure Ltd | 19.719 | 0,73 |

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|---|---|------------------|------------------------------|
| Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung) | | | |
| 1.630 | Nuance Communications Inc | 29.063 | 1,08 |
| 429 | Omniceil Inc | 35.058 | 1,30 |
| 223 | Penumbra Inc | 36.632 | 1,36 |
| 414 | PeptiDream Inc | 21.333 | 0,79 |
| 341 | PerkinElmer Inc | 33.111 | 1,23 |
| 5.507 | Ping An Healthcare and Technology Co Ltd '144A' | 40.180 | 1,49 |
| 930 | QIAGEN NV | 31.434 | 1,17 |
| 458 | Quidel Corp | 34.364 | 1,28 |
| 96 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 36.046 | 1,34 |
| 100 | Roche Holding AG | 32.426 | 1,20 |
| 787 | Siemens Healthineers AG '144A' | 37.827 | 1,40 |
| 1.230 | Smith & Nephew Plc | 29.859 | 1,11 |
| 938 | STAAR Surgical Co | 32.989 | 1,22 |
| 144 | Stryker Corp | 30.231 | 1,12 |
| 876 | Tabula Rasa HealthCare Inc | 42.644 | 1,58 |
| 462 | Tactile Systems Technology Inc | 31.190 | 1,16 |
| 121 | Tecan Group AG | 33.987 | 1,26 |
| 486 | Teladoc Health Inc | 40.688 | 1,51 |
| 560 | Terumo Corp | 20.019 | 0,74 |
| 121 | Thermo Fisher Scientific Inc | 39.309 | 1,46 |
| 281 | Varian Medical Systems Inc | 39.905 | 1,48 |
| 134 | Veeva Systems Inc - Class A | 18.848 | 0,70 |
| 1.199 | Veracyte Inc | 33.476 | 1,24 |
| 131 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 28.682 | 1,06 |
| 1.751 | Vocera Communications Inc | 36.351 | 1,35 |
| Stammaktien insgesamt | | 2.697.523 | 100,09 |

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF**Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Gesamtanlagen | | |
|--|------------------|------------------------------|
| Stammaktien | 2.697.523 | 100,09 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | (2.344) | (0,09) |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 2.695.179 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | % des Gesamtvermögens |
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 99,99 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 0,01 |
| | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|--------------------|--|-----------|------------------------------|
| Stammaktien | | | |
| 27.687 | 3i Group Plc | 358.785 | 0,16 |
| 4.811 | AAK AB | 81.499 | 0,04 |
| 2.653 | Aalberts NV | 106.147 | 0,05 |
| 62.432 | ABB Ltd | 1.342.288 | 0,59 |
| 12.949 | ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A' | 210.033 | 0,09 |
| 5.943 | Accor SA | 248.120 | 0,11 |
| 582 | Ackermans & van Haaren NV | 81.305 | 0,04 |
| 7.185 | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA | 256.145 | 0,11 |
| 4.348 | Adecco Group AG | 244.885 | 0,11 |
| 5.238 | adidas AG | 1.517.972 | 0,67 |
| 5.739 | Admiral Group Plc | 156.392 | 0,07 |
| 584 | Adyen NV '144A' | 426.904 | 0,19 |
| 735 | Aedifica SA (REIT) | 83.202 | 0,04 |
| 52.301 | Aegon NV | 212.708 | 0,09 |
| 2.124 | Aena SME SA '144A' | 362.142 | 0,16 |
| 732 | Aeroports de Paris | 128.905 | 0,06 |
| 5.144 | Ageas | 270.986 | 0,12 |
| 22.085 | AlB Group Plc | 68.596 | 0,03 |
| 6.066 | Air France-KLM | 60.199 | 0,03 |
| 13.292 | Air Liquide SA | 1.677.450 | 0,74 |
| 5.590 | Akzo Nobel NV | 506.678 | 0,22 |
| 14.333 | Alcon Inc | 722.599 | 0,32 |
| 8.667 | Alfa Laval AB | 194.579 | 0,09 |
| 12.073 | Allianz SE | 2.636.743 | 1,16 |
| 391 | Allreal Holding AG | 69.209 | 0,03 |
| 5.259 | Alstom SA | 222.088 | 0,10 |
| 5.096 | alstria office REIT-AG (REIT) | 85.358 | 0,04 |
| 784 | Alten SA | 88.200 | 0,04 |
| 9.692 | Altice Europe NV | 55.710 | 0,02 |
| 6.531 | Altran Technologies SA | 92.479 | 0,04 |
| 12.575 | Amadeus IT Group SA | 915.460 | 0,40 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|----------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 6.437 | Ambu A/S - Class B | 96.223 | 0,04 |
| 3.322 | Amplifon SpA | 85.176 | 0,04 |
| 2.312 | ams AG | 83.527 | 0,04 |
| 1.673 | Amundi SA '144A' | 116.943 | 0,05 |
| 1.904 | ANDRITZ AG | 73.114 | 0,03 |
| 35.866 | Anglo American Plc | 919.810 | 0,41 |
| 22.317 | Anheuser-Busch InBev SA/NV | 1.622.669 | 0,71 |
| 9.602 | Antofagasta Plc | 103.894 | 0,05 |
| 293 | AP Moller - Maersk A/S - Class B | 376.742 | 0,17 |
| 1.255 | Argenx SE | 180.218 | 0,08 |
| 2.139 | Arkema SA | 202.563 | 0,09 |
| 25.308 | Aroundtown SA | 202.059 | 0,09 |
| 13.526 | Ashmore Group Plc | 82.690 | 0,04 |
| 12.885 | Ashtead Group Plc | 367.094 | 0,16 |
| 1.342 | ASM International NV | 134.401 | 0,06 |
| 12.214 | ASML Holding NV | 3.220.832 | 1,42 |
| 3.939 | ASR Nederland NV | 131.405 | 0,06 |
| 30.267 | Assa Abloy AB | 630.830 | 0,28 |
| 41.067 | Assicurazioni Generali SpA | 755.427 | 0,33 |
| 10.099 | Associated British Foods Plc | 309.651 | 0,14 |
| 38.029 | AstraZeneca Plc | 3.414.160 | 1,50 |
| 23.807 | Atlas Copco AB | 846.468 | 0,37 |
| 2.810 | Atos SE | 208.839 | 0,09 |
| 25.319 | Auto Trader Group Plc '144A' | 177.675 | 0,08 |
| 17.502 | Avast Plc '144A' | 93.530 | 0,04 |
| 1.780 | AVEVA Group Plc | 97.811 | 0,04 |
| 114.726 | Aviva Plc | 566.918 | 0,25 |
| 55.574 | AXA SA | 1.395.463 | 0,61 |
| 23.612 | B&M European Value Retail SA | 114.143 | 0,05 |
| 1.358 | Baloise Holding AG | 218.634 | 0,10 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--------------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 192.898 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | 961.211 | 0,42 |
| 42.712 | Banco BPM SpA | 86.620 | 0,04 |
| 159.317 | Banco de Sabadell SA | 165.690 | 0,07 |
| 476.488 | Banco Santander SA | 1.777.300 | 0,78 |
| 26.008 | Bank of Ireland Group Plc | 126.971 | 0,06 |
| 4.355 | Bank Polska Kasa Opieki SA | 102.903 | 0,05 |
| 32.289 | Bankia SA | 61.430 | 0,03 |
| 17.930 | Bankinter SA | 117.119 | 0,05 |
| 503.245 | Barclays Plc | 1.066.935 | 0,47 |
| 29.556 | Barratt Developments Plc | 260.429 | 0,11 |
| 83 | Barry Callebaut AG | 163.255 | 0,07 |
| 26.735 | BASF SE | 1.800.602 | 0,79 |
| 28.536 | Bayer AG | 2.077.706 | 0,91 |
| 9.284 | Bayerische Motoren Werke AG | 679.032 | 0,30 |
| 14.339 | Beazley Plc | 94.091 | 0,04 |
| 771 | Bechtle AG | 96.529 | 0,04 |
| 2.851 | Beiersdorf AG | 304.059 | 0,13 |
| 14 | Belimo Holding AG | 93.893 | 0,04 |
| 3.398 | Bellway Plc | 152.673 | 0,07 |
| 3.373 | Berkeley Group Holdings Plc | 193.428 | 0,09 |
| 61.295 | BHP Group Plc | 1.285.344 | 0,57 |
| 1.158 | BioMerieux | 91.887 | 0,04 |
| 31.564 | BNP Paribas SA | 1.667.526 | 0,73 |
| 7.859 | Boliden AB | 185.863 | 0,08 |
| 24.704 | Bollore SA | 96.099 | 0,04 |
| 2.297 | Bolsas y Mercados Espanoles SHMSF SA | 78.971 | 0,03 |
| 6.436 | Bouygues SA | 243.796 | 0,11 |
| 4.588 | Brenntag AG | 222.426 | 0,10 |
| 26.400 | British Land Co Plc/The (REIT) | 199.033 | 0,09 |
| 7.088 | Britvic Plc | 75.664 | 0,03 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 245.173 | BT Group Plc | 556.831 | 0,25 |
| 9.988 | Bunzl Plc | 243.419 | 0,11 |
| 11.768 | Burberry Group Plc | 306.243 | 0,13 |
| 8.019 | Bureau Veritas SA | 186.522 | 0,08 |
| 103.944 | CaixaBank SA | 290.835 | 0,13 |
| 4.601 | Capgemini SE | 501.049 | 0,22 |
| 46.370 | Capita Plc | 89.805 | 0,04 |
| 1.026 | Carl Zeiss Meditec AG | 116.656 | 0,05 |
| 2.956 | Carlsberg A/S | 393.140 | 0,17 |
| 4.720 | Carnival Plc | 202.991 | 0,09 |
| 17.791 | Carrefour SA | 265.975 | 0,12 |
| 1.394 | Casino Guichard Perrachon SA | 58.130 | 0,03 |
| 7.003 | Castellum AB | 146.624 | 0,06 |
| 1.877 | CD Projekt SA | 123.406 | 0,05 |
| 10.763 | Cellnex Telecom SA '144A' | 412.976 | 0,18 |
| 766 | Cembra Money Bank AG | 74.699 | 0,03 |
| 170.073 | Centrica Plc | 179.243 | 0,08 |
| 3 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | 235.976 | 0,10 |
| 2.998 | Chr Hansen Holding A/S | 212.402 | 0,09 |
| 14.284 | Cie de Saint-Gobain | 521.366 | 0,23 |
| 14.851 | Cie Financiere Richemont SA | 1.039.182 | 0,46 |
| 4.876 | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | 531.972 | 0,23 |
| 27.606 | Cineworld Group Plc | 71.384 | 0,03 |
| 6.576 | Clariant AG | 130.676 | 0,06 |
| 4.078 | Close Brothers Group Plc | 76.909 | 0,03 |
| 28.917 | CNH Industrial NV | 283.097 | 0,12 |
| 4.122 | CNP Assurances | 73.083 | 0,03 |
| 66.605 | Cobham Plc | 129.112 | 0,06 |
| 5.688 | Coca-Cola HBC AG | 172.188 | 0,08 |
| 728 | Cofinimmo SA (REIT) | 95.368 | 0,04 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|----------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 4.745 | Coloplast A/S | 524.771 | 0,23 |
| 1.557 | Colruyt SA | 72.369 | 0,03 |
| 29.747 | Commerzbank AG | 164.114 | 0,07 |
| 46.019 | Compass Group Plc | 1.026.490 | 0,45 |
| 3.155 | Continental AG | 363.645 | 0,16 |
| 44.016 | ConvaTec Group Plc '144A' | 103.090 | 0,05 |
| 5.034 | Covestro AG '144A' | 208.659 | 0,09 |
| 1.648 | Covivio (REIT) | 166.778 | 0,07 |
| 33.409 | Credit Agricole SA | 431.811 | 0,19 |
| 72.375 | Credit Suisse Group AG | 872.580 | 0,38 |
| 22.937 | CRH Plc | 818.163 | 0,36 |
| 3.736 | Croda International Plc | 225.752 | 0,10 |
| 1.599 | CTS Eventim AG & Co KGaA | 89.624 | 0,04 |
| 23.494 | Daimler AG | 1.159.899 | 0,51 |
| 18.531 | Danone SA | 1.369.441 | 0,60 |
| 3.885 | Dassault Systemes SE | 569.347 | 0,25 |
| 15.486 | Davide Campari-Milano SpA | 126.056 | 0,06 |
| 2.803 | DCC Plc | 216.482 | 0,10 |
| 3.033 | Dechra Pharmaceuticals Plc | 103.807 | 0,05 |
| 4.106 | Delivery Hero SE '144A' | 289.719 | 0,13 |
| 2.764 | Demant A/S | 77.605 | 0,03 |
| 2.749 | Derwent London Plc (REIT) | 130.099 | 0,06 |
| 53.866 | Deutsche Bank AG | 372.591 | 0,16 |
| 5.331 | Deutsche Boerse AG | 747.140 | 0,33 |
| 13.349 | Deutsche Lufthansa AG | 219.057 | 0,10 |
| 28.474 | Deutsche Post AG | 968.401 | 0,43 |
| 93.341 | Deutsche Telekom AG | 1.359.978 | 0,60 |
| 10.653 | Deutsche Wohnen SE | 387.982 | 0,17 |
| 67.742 | Diageo Plc | 2.558.771 | 1,13 |
| 2.189 | Dialog Semiconductor Plc | 98.746 | 0,04 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|---------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 622 | DiaSorin SpA | 71.779 | 0,03 |
| 40.376 | Direct Line Insurance Group Plc | 148.912 | 0,07 |
| 26.078 | DNB ASA | 433.596 | 0,19 |
| 8.291 | Dometic Group AB '144A' | 74.423 | 0,03 |
| 36.893 | DS Smith Plc | 167.285 | 0,07 |
| 6.495 | DSV PANALPINA A/S | 667.377 | 0,29 |
| 1.074 | Dufry AG | 94.874 | 0,04 |
| 63.493 | E.ON SE | 604.707 | 0,27 |
| 7.331 | easyJet Plc | 123.248 | 0,05 |
| 7.149 | Edenred | 329.569 | 0,15 |
| 67.859 | EDP - Energias de Portugal SA | 262.207 | 0,12 |
| 2.331 | Eiffage SA | 237.762 | 0,10 |
| 13.858 | Electricite de France SA | 137.582 | 0,06 |
| 12.012 | Electrocomponents Plc | 96.060 | 0,04 |
| 7.846 | Electrolux AB | 171.667 | 0,08 |
| 10.069 | Elekta AB | 118.202 | 0,05 |
| 1.783 | Elia System Operator SA/NV | 141.035 | 0,06 |
| 6.163 | Elis SA | 114.016 | 0,05 |
| 4.116 | Elisa Oyj | 202.713 | 0,09 |
| 198 | EMS-Chemie Holding AG | 115.943 | 0,05 |
| 5.967 | Enagas SA | 135.690 | 0,06 |
| 9.082 | Endesa SA | 216.061 | 0,10 |
| 223.943 | Enel SpA | 1.583.725 | 0,70 |
| 50.537 | Engie SA | 727.733 | 0,32 |
| 23.551 | Epiroc AB | 256.298 | 0,11 |
| 15.611 | EQT AB | 161.792 | 0,07 |
| 8.075 | Erste Group Bank AG | 270.997 | 0,12 |
| 8.067 | EssilorLuxottica SA | 1.095.499 | 0,48 |
| 18.706 | Essity AB | 537.278 | 0,24 |
| 1.164 | Eurazeo SE | 71.004 | 0,03 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|---|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 336 | Eurofins Scientific SE | 166.051 | 0,07 |
| 1.710 | Euronext NV '144A' | 124.232 | 0,05 |
| 6.477 | Eutelsat Communications SA | 93.852 | 0,04 |
| 3.478 | Evolution Gaming Group AB '144A' | 93.342 | 0,04 |
| 4.657 | Evonik Industries AG | 126.717 | 0,06 |
| 4.035 | Evotec SE | 93.007 | 0,04 |
| 3.017 | EXOR NV | 208.414 | 0,09 |
| 26.406 | Experian Plc | 795.315 | 0,35 |
| 7.334 | Fabege AB | 108.675 | 0,05 |
| 2.772 | Fastighets AB Balder - Class B | 114.283 | 0,05 |
| 2.045 | Faurecia SE | 98.221 | 0,04 |
| 6.495 | Ferguson Plc | 525.080 | 0,23 |
| 3.614 | Ferrari NV | 534.511 | 0,24 |
| 13.880 | Ferrovial SA | 374.344 | 0,16 |
| 31.572 | Fiat Chrysler Automobiles NV | 416.561 | 0,18 |
| 17.686 | FinecoBank Banca Fineco SpA | 189.063 | 0,08 |
| 523 | Flughafen Zurich AG | 85.019 | 0,04 |
| 2.080 | Flutter Entertainment Plc | 225.368 | 0,10 |
| 1.027 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | 77.826 | 0,03 |
| 3.492 | Freenet AG | 71.376 | 0,03 |
| 5.901 | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | 389.230 | 0,17 |
| 12.228 | Fresenius SE & Co KGaA | 613.601 | 0,27 |
| 1.920 | FUCHS PETROLUB SE - Preference | 84.787 | 0,04 |
| 1.415 | Galapagos NV | 263.898 | 0,12 |
| 1.301 | Galenica AG '144A' | 71.634 | 0,03 |
| 4.621 | GEA Group AG | 136.227 | 0,06 |
| 1.054 | Geberit AG | 526.720 | 0,23 |
| 1.444 | Gecina SA (REIT) | 230.462 | 0,10 |
| 1.863 | Genmab A/S | 369.367 | 0,16 |
| 114 | Georg Fischer AG | 103.095 | 0,05 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 6.055 | Getinge AB | 100.268 | 0,04 |
| 12.333 | Getlink SE | 191.285 | 0,08 |
| 230 | Givaudan SA | 641.348 | 0,28 |
| 14.381 | Gjensidige Forsikring ASA | 268.636 | 0,12 |
| 5.648 | Glanbia Plc | 57.948 | 0,03 |
| 143.753 | GlaxoSmithKline Plc | 3.018.203 | 1,33 |
| 320.232 | Glencore Plc | 889.477 | 0,39 |
| 3.648 | GN Store Nord A/S | 152.953 | 0,07 |
| 2.872 | Grand City Properties SA | 61.403 | 0,03 |
| 7.219 | Great Portland Estates Plc (REIT) | 73.271 | 0,03 |
| 2.694 | Greggs Plc | 73.064 | 0,03 |
| 773 | GRENKE AG | 71.309 | 0,03 |
| 8.599 | Grifols SA | 270.267 | 0,12 |
| 2.170 | Groupe Bruxelles Lambert SA | 203.893 | 0,09 |
| 16.796 | GVC Holdings Plc | 175.272 | 0,08 |
| 5.561 | H Lundbeck A/S | 189.327 | 0,08 |
| 10.906 | Halma Plc | 272.356 | 0,12 |
| 20.632 | Hammerson Plc (REIT) | 75.168 | 0,03 |
| 1.727 | Hannover Rueck SE | 297.562 | 0,13 |
| 7.680 | Hargreaves Lansdown Plc | 175.387 | 0,08 |
| 39.712 | Hays Plc | 85.112 | 0,04 |
| 2.707 | Heineken Holding NV | 233.885 | 0,10 |
| 6.778 | Heineken NV | 643.368 | 0,28 |
| 1.148 | Hella GmbH & Co KGaA | 56.642 | 0,03 |
| 4.089 | HelloFresh SE | 76.301 | 0,03 |
| 879 | Helvetia Holding AG | 110.625 | 0,05 |
| 5.060 | Henkel AG & Co KGaA - Preference | 466.532 | 0,21 |
| 21.278 | Hennes & Mauritz AB | 385.726 | 0,17 |
| 25.297 | Hera SpA | 98.658 | 0,04 |
| 974 | Hermes International | 648.879 | 0,29 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 7.810 | Hexagon AB | 390.220 | 0,17 |
| 7.072 | Hexpol AB | 61.785 | 0,03 |
| 3.709 | Hikma Pharmaceuticals Plc | 87.153 | 0,04 |
| 7.784 | Hiscox Ltd | 130.818 | 0,06 |
| 514 | HOCHTIEF AG | 58.442 | 0,03 |
| 8.087 | HomeServe Plc | 120.640 | 0,05 |
| 16.681 | Howden Joinery Group Plc | 132.414 | 0,06 |
| 588.769 | HSBC Holdings Plc | 4.112.907 | 1,81 |
| 1.726 | HUGO BOSS AG | 74.667 | 0,03 |
| 2.499 | Huhtamaki Oyj | 103.409 | 0,05 |
| 12.856 | Husqvarna AB | 91.787 | 0,04 |
| 179.803 | Iberdrola SA | 1.650.592 | 0,73 |
| 2.522 | ICA Gruppen AB | 104.936 | 0,05 |
| 831 | ICADE (REIT) | 80.649 | 0,04 |
| 10.174 | IG Group Holdings Plc | 83.451 | 0,04 |
| 791 | Iliad SA | 91.400 | 0,04 |
| 1.453 | IMCD NV | 113.043 | 0,05 |
| 7.531 | IMI Plc | 104.791 | 0,05 |
| 2.293 | IMMOFINANZ AG | 54.803 | 0,02 |
| 11.211 | Inchcape Plc | 93.412 | 0,04 |
| 31.998 | Industria de Diseno Textil SA | 1.006.337 | 0,44 |
| 2.511 | Industrivarden AB - Class A | 55.441 | 0,02 |
| 2.496 | Indutrade AB | 79.625 | 0,04 |
| 36.248 | Infineon Technologies AG | 736.197 | 0,32 |
| 36.678 | Informa Plc | 370.973 | 0,16 |
| 113.570 | ING Groep NV | 1.213.836 | 0,53 |
| 1.810 | Ingenico Group SA | 175.208 | 0,08 |
| 9.759 | Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT) | 110.862 | 0,05 |
| 4.922 | InterContinental Hotels Group Plc | 302.530 | 0,13 |
| 7.759 | Intermediate Capital Group Plc | 147.430 | 0,07 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 45.350 | International Consolidated Airlines Group SA | 334.513 | 0,15 |
| 2.041 | Interpump Group SpA | 57.638 | 0,03 |
| 4.701 | Intertek Group Plc | 324.676 | 0,14 |
| 487.191 | Intesa Sanpaolo SpA | 1.144.168 | 0,50 |
| 18.711 | Investec Plc | 97.849 | 0,04 |
| 13.248 | Investor AB | 644.525 | 0,28 |
| 991 | Ipsen SA | 78.289 | 0,03 |
| 4.390 | ISS A/S | 93.912 | 0,04 |
| 12.634 | Italgas SpA | 68.780 | 0,03 |
| 100.559 | ITV Plc | 179.206 | 0,08 |
| 18.280 | IWG Plc | 93.955 | 0,04 |
| 65.760 | J Sainsbury Plc | 178.425 | 0,08 |
| 2.078 | JCDecaux SA | 57.103 | 0,03 |
| 12.486 | JD Sports Fashion Plc | 123.399 | 0,05 |
| 6.785 | Jeronimo Martins SGPS SA | 99.502 | 0,04 |
| 18.189 | John Wood Group Plc | 85.545 | 0,04 |
| 5.618 | Johnson Matthey Plc | 198.646 | 0,09 |
| 6.378 | Julius Baer Group Ltd | 292.972 | 0,13 |
| 11.575 | Jupiter Fund Management Plc | 55.955 | 0,02 |
| 16.496 | Just Eat Plc | 162.524 | 0,07 |
| 8.131 | KBC Group NV | 545.265 | 0,24 |
| 2.165 | Kering SA | 1.266.958 | 0,56 |
| 4.483 | Kerry Group Plc | 498.061 | 0,22 |
| 1.780 | Kesko Oyj | 112.282 | 0,05 |
| 3.990 | KGHM Polska Miedz SA | 89.708 | 0,04 |
| 62.378 | Kingfisher Plc | 159.752 | 0,07 |
| 4.434 | Kingspan Group Plc | 241.431 | 0,11 |
| 7.058 | Kinnevik AB | 153.821 | 0,07 |
| 1.826 | KION Group AG | 112.409 | 0,05 |
| 6.733 | Klepierre SA (REIT) | 227.912 | 0,10 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|---|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 1.347 | Knorr-Bremse AG | 122.240 | 0,05 |
| 4.299 | Kojamo Oyj | 69.644 | 0,03 |
| 9.343 | Kone Oyj - Class B | 544.510 | 0,24 |
| 29.549 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | 658.795 | 0,29 |
| 5.105 | Koninklijke DSM NV | 592.691 | 0,26 |
| 102.795 | Koninklijke KPN NV | 270.454 | 0,12 |
| 26.218 | Koninklijke Philips NV | 1.141.007 | 0,50 |
| 1.783 | Koninklijke Vopak NV | 86.172 | 0,04 |
| 1.449 | Kuehne + Nagel International AG | 217.555 | 0,10 |
| 2.027 | L E Lundbergforetagen AB | 79.286 | 0,04 |
| 3.192 | Lagardere SCA | 62.021 | 0,03 |
| 21.814 | Land Securities Group Plc (REIT) | 254.874 | 0,11 |
| 2.443 | LANXESS AG | 146.140 | 0,06 |
| 2.018 | LEG Immobilien AG | 213.000 | 0,09 |
| 171.271 | Legal & General Group Plc | 612.466 | 0,27 |
| 7.466 | Legrand SA | 542.330 | 0,24 |
| 15.576 | Linde Plc | 2.971.901 | 1,31 |
| 2.034.969 | Lloyds Banking Group Plc | 1.501.044 | 0,66 |
| 4.797 | Logitech International SA | 202.255 | 0,09 |
| 9.934 | London Stock Exchange Group Plc | 908.618 | 0,40 |
| 2.180 | Lonza Group AG | 708.365 | 0,31 |
| 2.021 | Loomis AB - Class B | 74.589 | 0,03 |
| 6.781 | L'Oreal SA | 1.790.184 | 0,79 |
| 35 | LPP SA | 72.615 | 0,03 |
| 7.690 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 3.185.198 | 1,40 |
| 76.605 | M&G Plc | 214.451 | 0,09 |
| 42.008 | Man Group Plc/Jersey | 78.333 | 0,03 |
| 26.076 | Mapfre SA | 61.539 | 0,03 |
| 53.867 | Marks & Spencer Group Plc | 135.730 | 0,06 |
| 21.604 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA | 212.022 | 0,09 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|---|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 21.466 | Meggitt Plc | 166.395 | 0,07 |
| 140.143 | Melrose Industries Plc | 397.118 | 0,18 |
| 3.793 | Merck KGaA | 399.593 | 0,18 |
| 9.923 | Merlin Properties Socimi SA (REIT) | 126.915 | 0,06 |
| 4.707 | METRO AG | 67.545 | 0,03 |
| 3.460 | Metso Oyj | 121.723 | 0,05 |
| 9.601 | Micro Focus International Plc | 120.540 | 0,05 |
| 5.721 | Moncler SpA | 229.240 | 0,10 |
| 14.274 | Mondi Plc | 298.598 | 0,13 |
| 15.298 | Moneysupermarket.com Group Plc | 59.689 | 0,03 |
| 901 | MorphoSys AG | 114.247 | 0,05 |
| 13.122 | Mowi ASA | 303.587 | 0,13 |
| 1.514 | MTU Aero Engines AG | 385.464 | 0,17 |
| 4.164 | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 1.095.132 | 0,48 |
| 99.801 | National Grid Plc | 1.112.245 | 0,49 |
| 23.770 | Natixis SA | 94.082 | 0,04 |
| 8.113 | Naturgy Energy Group SA | 181.731 | 0,08 |
| 1.525 | Nemetschek SE | 89.670 | 0,04 |
| 12.117 | Neste Oyj | 375.869 | 0,17 |
| 83.859 | Nestle SA | 8.083.656 | 3,56 |
| 11.251 | Network International Holdings Plc '144A' | 85.115 | 0,04 |
| 7.401 | Nexi SpA '144A' | 91.624 | 0,04 |
| 3.647 | Next Plc | 302.068 | 0,13 |
| 9.573 | Nibe Industrier AB | 147.956 | 0,07 |
| 2.402 | NMC Health Plc | 50.092 | 0,02 |
| 8.398 | NN Group NV | 284.020 | 0,13 |
| 157.529 | Nokia Oyj | 519.216 | 0,23 |
| 3.694 | Nokian Renkaat Oyj | 94.677 | 0,04 |
| 87.993 | Nordea Bank Abp | 633.430 | 0,28 |
| 37.132 | Norsk Hydro ASA | 122.876 | 0,05 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|---|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 48.145 | Novo Nordisk A/S | 2.491.224 | 1,10 |
| 6.140 | Novozymes A/S | 267.873 | 0,12 |
| 5.502 | OC Oerlikon Corp AG | 57.501 | 0,03 |
| 12.083 | Ocado Group Plc | 182.390 | 0,08 |
| 130.054 | Old Mutual Ltd | 161.932 | 0,07 |
| 62.961 | Orange SA | 826.048 | 0,36 |
| 2.757 | Orion Oyj | 113.781 | 0,05 |
| 22.645 | Orkla ASA | 204.237 | 0,09 |
| 1.588 | Orpea | 181.508 | 0,08 |
| 4.916 | Orsted A/S '144A' | 453.289 | 0,20 |
| 2.242 | OSRAM Licht AG | 98.984 | 0,04 |
| 2.582 | Pandora A/S | 100.138 | 0,04 |
| 1.016 | Pargesa Holding SA | 75.197 | 0,03 |
| 513 | Partners Group Holding AG | 418.810 | 0,18 |
| 21.766 | Pearson Plc | 163.634 | 0,07 |
| 11.773 | Pennon Group Plc | 142.419 | 0,06 |
| 5.774 | Pernod Ricard SA | 920.376 | 0,41 |
| 8.871 | Persimmon Plc | 282.154 | 0,12 |
| 19.144 | Peugeot SA | 407.767 | 0,18 |
| 21.344 | Phoenix Group Holdings Plc | 188.675 | 0,08 |
| 11.702 | Pirelli & C SpA '144A' | 60.148 | 0,03 |
| 8.047 | Polski Koncern Naftowy ORLEN SA | 162.447 | 0,07 |
| 8.206 | Polymetal International Plc | 115.732 | 0,05 |
| 4.455 | Porsche Automobil Holding SE - Preference | 296.881 | 0,13 |
| 11.520 | Poste Italiane SpA '144A' | 116.582 | 0,05 |
| 25.345 | Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA | 205.446 | 0,09 |
| 15.659 | Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA | 147.448 | 0,07 |
| 5.456 | ProSiebenSat.1 Media SE | 75.893 | 0,03 |
| 12.167 | Prosus NV | 809.471 | 0,36 |
| 3.960 | Proximus SADP | 101.059 | 0,04 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|---------------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 75.063 | Prudential Plc | 1.283.660 | 0,57 |
| 7.082 | Prysmian SpA | 152.192 | 0,07 |
| 1.211 | PSP Swiss Property AG | 148.844 | 0,07 |
| 6.754 | Publicis Groupe SA | 272.591 | 0,12 |
| 2.326 | Puma SE | 158.982 | 0,07 |
| 6.245 | QIAGEN NV | 190.223 | 0,08 |
| 50.567 | Quilter Plc '144A' | 96.113 | 0,04 |
| 3.754 | Raiffeisen Bank International AG | 84.052 | 0,04 |
| 3.606 | Randstad NV | 196.311 | 0,09 |
| 19.876 | Reckitt Benckiser Group Plc | 1.437.720 | 0,63 |
| 2.688 | Recordati SpA | 100.988 | 0,04 |
| 12.029 | Red Electrica Corp SA | 215.620 | 0,10 |
| 56.376 | RELX Plc | 1.267.824 | 0,56 |
| 609 | Remy Cointreau SA | 66.686 | 0,03 |
| 5.435 | Renault SA | 229.248 | 0,10 |
| 53.420 | Rentokil Initial Plc | 285.600 | 0,13 |
| 6.838 | Rexel SA | 80.996 | 0,04 |
| 1.206 | Rheinmetall AG | 123.494 | 0,05 |
| 25.997 | Rightmove Plc | 194.399 | 0,09 |
| 30.966 | Rio Tinto Plc | 1.645.670 | 0,72 |
| 20.235 | Roche Holding AG | 5.845.378 | 2,57 |
| 56.129 | Rolls-Royce Holdings Plc | 452.575 | 0,20 |
| 2.444.348 | Rolls-Royce Holdings Plc - Preference | 2.885 | 0,00 |
| 24.116 | Rotork Plc | 95.347 | 0,04 |
| 133.733 | Royal Bank of Scotland Group Plc | 379.270 | 0,17 |
| 27.869 | Royal Mail Plc | 74.432 | 0,03 |
| 1.362 | Royal Unibrew A/S | 111.186 | 0,05 |
| 30.857 | RSA Insurance Group Plc | 205.977 | 0,09 |
| 2.675 | Rubis SCA | 146.456 | 0,06 |
| 30.580 | Ryanair Holdings Plc | 447.385 | 0,20 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|------------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 3.346 | Saab AB | 99.926 | 0,04 |
| 31.821 | Sage Group Plc/The | 281.288 | 0,12 |
| 15.808 | Saipem SpA | 68.860 | 0,03 |
| 1.462 | Salmar ASA | 66.596 | 0,03 |
| 14.068 | Sampo Oyj - Class A | 547.386 | 0,24 |
| 35.055 | Sandvik AB | 609.352 | 0,27 |
| 32.355 | Sanofi | 2.899.655 | 1,28 |
| 917 | Santander Bank Polska SA | 66.308 | 0,03 |
| 30.445 | SAP SE | 3.663.142 | 1,61 |
| 1.006 | Sartorius AG - Preference | 191.945 | 0,08 |
| 673 | Sartorius Stedim Biotech | 99.402 | 0,04 |
| 5.369 | Schibsted ASA | 144.410 | 0,06 |
| 1.186 | Schindler Holding AG | 268.629 | 0,12 |
| 15.354 | Schneider Electric SE | 1.404.891 | 0,62 |
| 3.318 | Schroders Plc | 130.556 | 0,06 |
| 4.545 | SCOR SE | 170.074 | 0,08 |
| 2.803 | Scout24 AG '144A' | 165.237 | 0,07 |
| 829 | SEB SA | 109.760 | 0,05 |
| 9.329 | Securitas AB | 143.342 | 0,06 |
| 32.439 | Segro Plc (REIT) | 343.489 | 0,15 |
| 10.615 | SES SA Receipt - Class A | 132.688 | 0,06 |
| 7.047 | Severn Trent Plc | 209.169 | 0,09 |
| 147 | SGS SA | 358.515 | 0,16 |
| 21.908 | Siemens AG | 2.553.158 | 1,12 |
| 6.238 | Siemens Gamesa Renewable Energy SA | 97.531 | 0,04 |
| 4.378 | Siemens Healthineers AG '144A' | 187.466 | 0,08 |
| 6.316 | SIG Combibloc Group AG | 89.832 | 0,04 |
| 23.079 | Signature Aviation Plc | 86.398 | 0,04 |
| 3.629 | Signify NV '144A' | 101.104 | 0,04 |
| 3.464 | Sika AG | 579.523 | 0,26 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 1.110 | SimCorp A/S | 112.525 | 0,05 |
| 58.568 | Skandinaviska Enskilda Banken AB | 490.949 | 0,22 |
| 10.454 | Skanska AB | 210.621 | 0,09 |
| 12.457 | SKF AB | 224.539 | 0,10 |
| 25.494 | Smith & Nephew Plc | 551.363 | 0,24 |
| 11.680 | Smiths Group Plc | 232.549 | 0,10 |
| 6.870 | Smurfit Kappa Group Plc | 235.366 | 0,10 |
| 59.168 | Snam SpA | 277.261 | 0,12 |
| 22.933 | Societe Generale SA | 711.267 | 0,31 |
| 2.432 | Sodexo SA | 256.941 | 0,11 |
| 411 | Sofina SA | 79.159 | 0,03 |
| 2.077 | Solvay SA | 214.554 | 0,09 |
| 1.536 | Sonova Holding AG | 313.000 | 0,14 |
| 397 | Sopra Steria Group | 56.970 | 0,03 |
| 3.161 | Spectris Plc | 108.412 | 0,05 |
| 3.738 | SPIE SA | 67.882 | 0,03 |
| 2.147 | Spirax-Sarco Engineering Plc | 225.263 | 0,10 |
| 30.118 | SSE Plc | 511.319 | 0,23 |
| 11.989 | SSP Group Plc | 91.971 | 0,04 |
| 14.621 | St James's Place Plc | 200.943 | 0,09 |
| 92.920 | Standard Chartered Plc | 781.248 | 0,34 |
| 67.540 | Standard Life Aberdeen Plc | 261.531 | 0,12 |
| 18.736 | STMicroelectronics NV | 449.102 | 0,20 |
| 15.985 | Stora Enso Oyj | 207.246 | 0,09 |
| 13.016 | Storebrand ASA | 91.079 | 0,04 |
| 297 | Straumann Holding AG | 259.682 | 0,11 |
| 6.107 | Subsea 7 SA | 64.980 | 0,03 |
| 9.358 | Suez | 126.193 | 0,06 |
| 937 | Sunrise Communications Group AG '144A' | 65.557 | 0,03 |
| 18.661 | Svenska Cellulosa AB SCA - Class B | 168.716 | 0,07 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|---|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 49.464 | Svenska Handelsbanken AB | 474.984 | 0,21 |
| 811 | Swatch Group AG/The | 201.449 | 0,09 |
| 25.851 | Swedbank AB | 343.080 | 0,15 |
| 7.510 | Swedish Orphan Biovitrum AB | 110.425 | 0,05 |
| 968 | Swiss Life Holding AG | 432.626 | 0,19 |
| 2.193 | Swiss Prime Site AG | 225.761 | 0,10 |
| 8.061 | Swiss Re AG | 806.117 | 0,36 |
| 729 | Swisscom AG | 343.784 | 0,15 |
| 3.595 | Symrise AG - Class A | 337.211 | 0,15 |
| 3.661 | TAG Immobilien AG | 81.128 | 0,04 |
| 1.127 | Takeaway.com NV '144A' | 92.639 | 0,04 |
| 12.676 | Tate & Lyle Plc | 113.728 | 0,05 |
| 95.701 | Taylor Wimpey Plc | 218.438 | 0,10 |
| 332 | Tecan Group AG | 83.078 | 0,04 |
| 12.591 | TechnipFMC Plc | 238.096 | 0,10 |
| 19.280 | Tele2 AB | 249.267 | 0,11 |
| 278.495 | Telecom Italia SpA/Milano | 154.955 | 0,07 |
| 88.704 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B | 688.524 | 0,30 |
| 22.933 | Telefonica Deutschland Holding AG | 59.259 | 0,03 |
| 133.114 | Telefonica SA | 828.901 | 0,37 |
| 1.191 | Telenet Group Holding NV | 47.711 | 0,02 |
| 18.615 | Telenor ASA | 297.148 | 0,13 |
| 1.683 | Teleperformance | 365.884 | 0,16 |
| 73.493 | Telia Co AB | 281.521 | 0,12 |
| 1.853 | Temenos AG | 261.164 | 0,12 |
| 13.065 | Tenaris SA | 131.303 | 0,06 |
| 41.601 | Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | 247.692 | 0,11 |
| 275.598 | Tesco Plc | 830.065 | 0,37 |
| 3.642 | TGS NOPEC Geophysical Co ASA | 98.624 | 0,04 |
| 13.759 | thyssenkrupp AG | 165.658 | 0,07 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|----------------------------------|-----------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 4.162 | Tomra Systems ASA | 117.473 | 0,05 |
| 1.217 | Topdanmark A/S | 53.486 | 0,02 |
| 16.596 | TP ICAP Plc | 80.050 | 0,04 |
| 6.807 | Travis Perkins Plc | 128.699 | 0,06 |
| 6.753 | Trelleborg AB | 108.324 | 0,05 |
| 45.934 | Tritax Big Box REIT Plc (REIT) | 80.666 | 0,04 |
| 3.331 | Tryg A/S | 88.041 | 0,04 |
| 11.750 | TUI AG | 132.267 | 0,06 |
| 2.891 | Ubisoft Entertainment SA | 178.028 | 0,08 |
| 106.206 | UBS Group AG | 1.194.477 | 0,53 |
| 3.249 | UCB SA | 230.354 | 0,10 |
| 6.799 | UDG Healthcare Plc (Units) | 64.675 | 0,03 |
| 5.719 | Umicore SA | 247.976 | 0,11 |
| 4.030 | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | 566.820 | 0,25 |
| 62.181 | UniCredit SpA | 809.597 | 0,36 |
| 39.706 | Unilever NV | 2.034.138 | 0,90 |
| 32.522 | Unilever Plc | 1.669.829 | 0,74 |
| 28.658 | Unione di Banche Italiane SpA | 83.452 | 0,04 |
| 5.355 | Uniper SE | 158.026 | 0,07 |
| 10.864 | UNITE Group Plc/The (REIT) | 161.553 | 0,07 |
| 3.314 | United Internet AG | 97.034 | 0,04 |
| 19.208 | United Utilities Group Plc | 213.862 | 0,09 |
| 15.131 | UPM-Kymmene Oyj | 467.699 | 0,21 |
| 6.835 | Valeo SA | 214.687 | 0,09 |
| 3.663 | Valmet Oyj | 78.242 | 0,03 |
| 751 | VAT Group AG '144A' | 112.998 | 0,05 |
| 14.962 | Veolia Environnement SA | 354.749 | 0,16 |
| 3.331 | Verbund AG | 149.029 | 0,07 |
| 5.771 | Vestas Wind Systems A/S | 519.923 | 0,23 |
| 2.313 | Victrex Plc | 68.081 | 0,03 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert € | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|------------------------------|--------------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 1.219 | Vifor Pharma AG | 198.106 | 0,09 |
| 14.623 | Vinci SA | 1.447.677 | 0,64 |
| 34.088 | Virgin Money UK Plc | 75.855 | 0,03 |
| 23.208 | Vivendi SA | 599.231 | 0,26 |
| 776.222 | Vodafone Group Plc | 1.344.464 | 0,59 |
| 43.895 | Volvo AB | 655.446 | 0,29 |
| 15.770 | Vonovia SE | 756.960 | 0,33 |
| 563 | Warehouses De Pauw CVA | 91.319 | 0,04 |
| 16.006 | Wartsila OYJ Abp | 157.659 | 0,07 |
| 7.234 | Weir Group Plc/The | 128.875 | 0,06 |
| 729 | Wendel SA | 86.387 | 0,04 |
| 3.373 | WH Smith Plc | 103.501 | 0,05 |
| 3.854 | Whitbread Plc | 220.420 | 0,10 |
| 3.125 | Wienerberger AG | 82.563 | 0,04 |
| 3.411 | Wirecard AG | 366.683 | 0,16 |
| 71.376 | Wm Morrison Supermarkets Plc | 168.307 | 0,07 |
| 7.737 | Wolters Kluwer NV | 503.060 | 0,22 |
| 2.860 | Worldline SA/France '144A' | 180.609 | 0,08 |
| 35.741 | WPP Plc | 449.866 | 0,20 |
| 4.874 | Yara International ASA | 180.461 | 0,08 |
| 4.370 | Zalando SE '144A' | 197.437 | 0,09 |
| 4.221 | Zurich Insurance Group AG | 1.542.038 | 0,68 |
| Stammaktien insgesamt | | 226.952.836 | 99,93 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Gesamtanlagen | | |
|--|--------------------|---------------|
| Stammaktien | 226.952.836 | 99,93 |
| Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 157.308 | 0,07 |
| Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 227.110.144 | 100,00 |

| Analyse des Gesamtvermögens | | % des Gesamtvermögens |
|--|--|------------------------------|
| Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 99,92 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 0,08 |
| | | 100,00 |
| Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | |

* Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|--------------------|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien | | | |
| 13.249 | 3M Co | 2.337.389 | 0,41 |
| 40.501 | Abbott Laboratories | 3.517.917 | 0,62 |
| 34.059 | AbbVie Inc | 3.015.584 | 0,53 |
| 15.462 | Accenture Plc - Class A | 3.255.833 | 0,57 |
| 17.469 | Activision Blizzard Inc | 1.038.008 | 0,18 |
| 11.119 | Adobe Inc | 3.667.157 | 0,64 |
| 1.579 | Advance Auto Parts Inc | 252.893 | 0,04 |
| 25.508 | Advanced Micro Devices Inc | 1.169.797 | 0,21 |
| 15.807 | Aflac Inc | 836.190 | 0,15 |
| 7.127 | Agilent Technologies Inc | 608.004 | 0,11 |
| 5.030 | Air Products & Chemicals Inc | 1.182.000 | 0,21 |
| 3.615 | Akamai Technologies Inc | 312.264 | 0,05 |
| 2.627 | Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT) | 424.471 | 0,07 |
| 5.094 | Alexion Pharmaceuticals Inc | 550.916 | 0,10 |
| 1.665 | Align Technology Inc | 464.602 | 0,08 |
| 319 | Alleghany Corp | 255.063 | 0,04 |
| 2.140 | Allegion Plc | 266.516 | 0,05 |
| 7.531 | Allergan Plc | 1.439.701 | 0,25 |
| 7.407 | Allstate Corp/The | 832.917 | 0,15 |
| 8.703 | Ally Financial Inc | 265.964 | 0,05 |
| 2.557 | Alnylam Pharmaceuticals Inc | 294.490 | 0,05 |
| 7.704 | Alphabet Inc | 10.300.402 | 1,80 |
| 6.620 | Alphabet Inc - Class A | 8.866.762 | 1,55 |
| 6.676 | Altice USA Inc | 182.522 | 0,03 |
| 9.638 | Amazon.com Inc | 17.809.482 | 3,12 |
| 37.479 | Amcor Plc | 406.272 | 0,07 |
| 10.169 | American Airlines Group Inc | 291.647 | 0,05 |
| 18.820 | American Express Co | 2.342.902 | 0,41 |
| 20.113 | American International Group Inc | 1.032.400 | 0,18 |
| 10.198 | American Tower Corp (REIT) | 2.343.704 | 0,41 |
| 4.064 | American Water Works Co Inc | 499.262 | 0,09 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 2.917 | Ameriprise Financial Inc | 485.914 | 0,09 |
| 3.427 | AmerisourceBergen Corp - Class A | 291.364 | 0,05 |
| 5.205 | AMETEK Inc | 519.147 | 0,09 |
| 13.650 | Amgen Inc | 3.290.605 | 0,58 |
| 6.817 | Amphenol Corp - Class A | 737.804 | 0,13 |
| 8.442 | Analog Devices Inc | 1.003.247 | 0,18 |
| 30.996 | Annaly Capital Management Inc (REIT) | 291.982 | 0,05 |
| 1.908 | ANSYS Inc | 491.138 | 0,09 |
| 5.822 | Anthem Inc | 1.758.419 | 0,31 |
| 5.388 | Aon Plc | 1.122.267 | 0,20 |
| 102.385 | Apple Inc | 30.065.355 | 5,27 |
| 21.201 | Applied Materials Inc | 1.294.109 | 0,23 |
| 5.813 | Aptiv Plc | 552.061 | 0,10 |
| 5.602 | Aramark | 243.127 | 0,04 |
| 8.912 | Arch Capital Group Ltd | 382.236 | 0,07 |
| 12.819 | Archer-Daniels-Midland Co | 594.161 | 0,10 |
| 9.905 | Arconic Inc | 304.777 | 0,05 |
| 1.249 | Arista Networks Inc | 254.047 | 0,04 |
| 4.263 | Arthur J Gallagher & Co | 405.965 | 0,07 |
| 168.194 | AT&T Inc | 6.573.022 | 1,15 |
| 2.749 | Atlassian Corp Plc | 330.815 | 0,06 |
| 2.737 | Atmos Energy Corp | 306.161 | 0,05 |
| 5.035 | Autodesk Inc | 923.721 | 0,16 |
| 9.955 | Automatic Data Processing Inc | 1.697.327 | 0,30 |
| 544 | AutoZone Inc | 648.073 | 0,11 |
| 3.195 | AvalonBay Communities Inc (REIT) | 669.991 | 0,12 |
| 1.129 | Avangrid Inc | 57.760 | 0,01 |
| 1.931 | Avery Dennison Corp | 252.613 | 0,04 |
| 10.130 | AXA Equitable Holdings Inc | 251.021 | 0,04 |
| 14.828 | Baker Hughes Co - Class A | 380.042 | 0,07 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 7.491 | Ball Corp | 484.443 | 0,08 |
| 207.478 | Bank of America Corp | 7.307.375 | 1,28 |
| 21.127 | Bank of New York Mellon Corp/The | 1.063.322 | 0,19 |
| 11.722 | Baxter International Inc | 980.194 | 0,17 |
| 6.225 | Becton Dickinson and Co | 1.693.013 | 0,30 |
| 31.765 | Berkshire Hathaway Inc - Class B | 7.194.772 | 1,26 |
| 5.241 | Best Buy Co Inc | 460.160 | 0,08 |
| 4.129 | Biogen Inc | 1.225.198 | 0,21 |
| 4.119 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 348.261 | 0,06 |
| 497 | Bio-Rad Laboratories Inc | 183.905 | 0,03 |
| 15.052 | Blackstone Group Inc/The | 842.009 | 0,15 |
| 957 | Booking Holdings Inc | 1.965.420 | 0,34 |
| 3.603 | Boston Properties Inc (REIT) | 496.710 | 0,09 |
| 32.067 | Boston Scientific Corp | 1.450.070 | 0,25 |
| 53.965 | Bristol-Myers Squibb Co | 3.464.013 | 0,61 |
| 8.899 | Broadcom Inc | 2.812.262 | 0,49 |
| 2.603 | Broadridge Financial Solutions Inc | 321.575 | 0,06 |
| 5.380 | Brown & Brown Inc | 212.402 | 0,04 |
| 723 | Brown-Forman Corp | 45.383 | 0,01 |
| 7.085 | Brown-Forman Corp | 478.946 | 0,08 |
| 1.519 | Burlington Stores Inc | 346.378 | 0,06 |
| 6.354 | Cadence Design Systems Inc | 440.713 | 0,08 |
| 2.126 | Camden Property Trust (REIT) | 225.569 | 0,04 |
| 3.938 | Campbell Soup Co | 194.616 | 0,03 |
| 10.687 | Capital One Financial Corp | 1.099.799 | 0,19 |
| 6.792 | Cardinal Health Inc | 343.539 | 0,06 |
| 3.748 | CarMax Inc | 328.587 | 0,06 |
| 10.015 | Carnival Corp | 509.062 | 0,09 |
| 12.783 | Caterpillar Inc | 1.887.793 | 0,33 |
| 2.437 | Cboe Global Markets Inc | 292.440 | 0,05 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 7.728 | CBRE Group Inc - Class A | 473.649 | 0,08 |
| 3.285 | CDW Corp/DE | 469.229 | 0,08 |
| 2.748 | Celanese Corp - Class A | 338.334 | 0,06 |
| 9.334 | Centene Corp | 586.829 | 0,10 |
| 11.614 | CenterPoint Energy Inc | 316.714 | 0,06 |
| 25.099 | CenturyLink Inc | 331.558 | 0,06 |
| 6.916 | Cerner Corp | 507.565 | 0,09 |
| 26.473 | Charles Schwab Corp/The | 1.259.056 | 0,22 |
| 3.492 | Charter Communications Inc | 1.693.899 | 0,30 |
| 5.717 | Cheniere Energy Inc | 349.137 | 0,06 |
| 628 | Chipotle Mexican Grill Inc - Class A | 525.705 | 0,09 |
| 10.331 | Chubb Ltd | 1.608.123 | 0,28 |
| 5.545 | Church & Dwight Co Inc | 390.035 | 0,07 |
| 8.495 | Cigna Corp | 1.737.143 | 0,30 |
| 3.451 | Cincinnati Financial Corp | 362.873 | 0,06 |
| 2.031 | Cintas Corp | 546.501 | 0,10 |
| 97.854 | Cisco Systems Inc | 4.693.078 | 0,82 |
| 50.298 | Citigroup Inc | 4.018.307 | 0,70 |
| 9.919 | Citizens Financial Group Inc | 402.811 | 0,07 |
| 2.851 | Citrix Systems Inc | 316.176 | 0,06 |
| 2.882 | Clorox Co/The | 442.502 | 0,08 |
| 8.087 | CME Group Inc | 1.623.223 | 0,28 |
| 6.278 | CMS Energy Corp | 394.510 | 0,07 |
| 6.044 | CNA Financial Corp | 270.832 | 0,05 |
| 98.047 | Coca-Cola Co/The | 5.426.901 | 0,95 |
| 12.521 | Cognizant Technology Solutions Corp | 776.552 | 0,14 |
| 19.736 | Colgate-Palmolive Co | 1.358.626 | 0,24 |
| 103.843 | Comcast Corp | 4.669.820 | 0,82 |
| 11.240 | Conagra Brands Inc | 384.858 | 0,07 |
| 7.502 | Consolidated Edison Inc | 678.706 | 0,12 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 3.491 | Constellation Brands Inc - Class A | 662.417 | 0,12 |
| 1.122 | Cooper Cos Inc/The | 360.487 | 0,06 |
| 4.633 | Copart Inc | 421.325 | 0,07 |
| 17.779 | Corning Inc | 517.547 | 0,09 |
| 17.204 | Corteva Inc | 508.550 | 0,09 |
| 836 | CoStar Group Inc | 500.179 | 0,09 |
| 10.141 | Costco Wholesale Corp | 2.980.643 | 0,52 |
| 9.567 | Crown Castle International Corp (REIT) | 1.359.949 | 0,24 |
| 17.997 | CSX Corp | 1.302.263 | 0,23 |
| 3.522 | Cummins Inc | 630.297 | 0,11 |
| 29.963 | CVS Health Corp | 2.225.951 | 0,39 |
| 14.769 | Danaher Corp | 2.266.746 | 0,40 |
| 2.769 | Darden Restaurants Inc | 301.849 | 0,05 |
| 7.250 | Deere & Co | 1.256.135 | 0,22 |
| 5.430 | Dell Technologies Inc | 279.048 | 0,05 |
| 14.836 | Delta Air Lines Inc | 867.609 | 0,15 |
| 5.065 | DENTSPLY SIRONA Inc | 286.628 | 0,05 |
| 2.097 | DexCom Inc | 458.698 | 0,08 |
| 4.826 | Digital Realty Trust Inc (REIT) | 577.865 | 0,10 |
| 7.171 | Discover Financial Services | 608.244 | 0,11 |
| 2.626 | Discovery Inc | 85.975 | 0,02 |
| 8.682 | Discovery Inc | 264.714 | 0,05 |
| 3.757 | DocuSign Inc - Class A | 278.431 | 0,05 |
| 5.775 | Dollar General Corp | 900.785 | 0,16 |
| 5.345 | Dollar Tree Inc | 502.697 | 0,09 |
| 18.913 | Dominion Energy Inc | 1.566.375 | 0,27 |
| 938 | Domino's Pizza Inc | 275.566 | 0,05 |
| 3.268 | Dover Corp | 376.670 | 0,07 |
| 17.123 | Dow Inc | 937.142 | 0,16 |
| 7.783 | DR Horton Inc | 410.553 | 0,07 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 4.375 | DTE Energy Co | 568.181 | 0,10 |
| 8.315 | Duke Realty Corp (REIT) | 288.281 | 0,05 |
| 17.039 | DuPont de Nemours Inc | 1.093.904 | 0,19 |
| 3.153 | Eastman Chemical Co | 249.907 | 0,04 |
| 9.562 | Eaton Corp Plc | 905.713 | 0,16 |
| 17.668 | eBay Inc | 637.991 | 0,11 |
| 6.558 | Ecolab Inc | 1.265.628 | 0,22 |
| 8.276 | Edison International | 624.093 | 0,11 |
| 4.783 | Edwards Lifesciences Corp | 1.115.826 | 0,20 |
| 6.677 | Electronic Arts Inc | 717.844 | 0,13 |
| 22.060 | Eli Lilly & Co | 2.899.346 | 0,51 |
| 14.059 | Emerson Electric Co | 1.072.139 | 0,19 |
| 4.500 | Entergy Corp | 539.100 | 0,09 |
| 1.223 | EPAM Systems Inc | 259.472 | 0,05 |
| 1.964 | Equinix Inc (REIT) | 1.146.387 | 0,20 |
| 3.940 | Equity LifeStyle Properties Inc (REIT) | 277.337 | 0,05 |
| 8.308 | Equity Residential (REIT) | 672.283 | 0,12 |
| 1.484 | Essex Property Trust Inc (REIT) | 446.476 | 0,08 |
| 4.872 | Estee Lauder Cos Inc/The - Class A | 1.006.263 | 0,18 |
| 684 | Everest Re Group Ltd | 189.359 | 0,03 |
| 7.222 | Eversource Energy | 614.376 | 0,11 |
| 3.364 | Exact Sciences Corp | 311.103 | 0,05 |
| 22.428 | Exelon Corp | 1.022.493 | 0,18 |
| 2.877 | Expedia Group Inc | 311.119 | 0,05 |
| 3.796 | Expeditors International of Washington Inc | 296.164 | 0,05 |
| 2.847 | Extra Space Storage Inc (REIT) | 300.700 | 0,05 |
| 54.876 | Facebook Inc - Class A | 11.263.299 | 1,97 |
| 646 | Fair Isaac Corp | 242.043 | 0,04 |
| 13.261 | Fastenal Co | 489.994 | 0,09 |
| 5.581 | FedEx Corp | 843.903 | 0,15 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 5.905 | Fidelity National Financial Inc | 267.792 | 0,05 |
| 14.095 | Fidelity National Information Services Inc | 1.960.474 | 0,34 |
| 16.209 | Fifth Third Bancorp | 498.265 | 0,09 |
| 3.790 | First Republic Bank/CA | 445.135 | 0,08 |
| 13.042 | Fiserv Inc | 1.508.046 | 0,26 |
| 1.969 | FleetCor Technologies Inc | 566.521 | 0,10 |
| 2.939 | FMC Corp | 293.371 | 0,05 |
| 88.893 | Ford Motor Co | 826.705 | 0,14 |
| 3.307 | Fortinet Inc | 353.055 | 0,06 |
| 6.804 | Fortive Corp | 519.758 | 0,09 |
| 11.611 | Fox Corp | 430.420 | 0,08 |
| 6.120 | Franklin Resources Inc | 158.998 | 0,03 |
| 3.114 | Garmin Ltd | 303.802 | 0,05 |
| 2.016 | Gartner Inc | 310.666 | 0,05 |
| 201.284 | General Electric Co | 2.246.329 | 0,39 |
| 13.892 | General Mills Inc | 744.056 | 0,13 |
| 30.242 | General Motors Co | 1.106.857 | 0,19 |
| 3.248 | Genuine Parts Co | 345.035 | 0,06 |
| 28.939 | Gilead Sciences Inc | 1.880.456 | 0,33 |
| 6.905 | Global Payments Inc | 1.260.577 | 0,22 |
| 2.428 | Globe Life Inc | 255.547 | 0,04 |
| 3.960 | GoDaddy Inc - Class A | 268.963 | 0,05 |
| 8.036 | Goldman Sachs Group Inc/The | 1.847.717 | 0,32 |
| 20.081 | Halliburton Co | 491.382 | 0,09 |
| 8.180 | Hartford Financial Services Group Inc/The | 497.099 | 0,09 |
| 2.964 | Hasbro Inc | 313.028 | 0,05 |
| 6.160 | HCA Healthcare Inc | 910.510 | 0,16 |
| 11.337 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | 390.786 | 0,07 |
| 2.208 | HEICO Corp | 252.043 | 0,04 |
| 3.374 | Hershey Co/The | 495.911 | 0,09 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 30.027 | Hewlett Packard Enterprise Co | 476.228 | 0,08 |
| 6.390 | Hilton Worldwide Holdings Inc | 708.715 | 0,12 |
| 6.123 | Hologic Inc | 319.682 | 0,06 |
| 25.126 | Home Depot Inc/The | 5.487.016 | 0,96 |
| 6.205 | Hormel Foods Corp | 279.908 | 0,05 |
| 16.591 | Host Hotels & Resorts Inc (REIT) | 307.763 | 0,05 |
| 34.181 | HP Inc | 702.420 | 0,12 |
| 3.047 | Humana Inc | 1.116.786 | 0,20 |
| 23.143 | Huntington Bancshares Inc/OH | 348.996 | 0,06 |
| 1.760 | IAC/InterActiveCorp | 438.434 | 0,08 |
| 1.725 | IDEX Corp | 296.700 | 0,05 |
| 1.956 | IDEXX Laboratories Inc | 510.770 | 0,09 |
| 8.589 | IHS Markit Ltd | 647.181 | 0,11 |
| 7.437 | Illinois Tool Works Inc | 1.335.908 | 0,23 |
| 3.388 | Illumina Inc | 1.123.935 | 0,20 |
| 4.903 | Incyte Corp | 428.130 | 0,08 |
| 5.449 | Ingersoll-Rand Plc | 724.281 | 0,13 |
| 1.412 | Insulet Corp | 241.734 | 0,04 |
| 100.215 | Intel Corp | 5.997.868 | 1,05 |
| 12.491 | Intercontinental Exchange Inc | 1.156.042 | 0,20 |
| 20.422 | International Business Machines Corp | 2.737.365 | 0,48 |
| 2.447 | International Flavors & Fragrances Inc | 315.712 | 0,06 |
| 9.132 | International Paper Co | 420.529 | 0,07 |
| 5.778 | Intuit Inc | 1.513.432 | 0,27 |
| 2.645 | Intuitive Surgical Inc | 1.563.592 | 0,27 |
| 12.311 | Invitation Homes Inc (REIT) | 368.961 | 0,06 |
| 4.289 | IQVIA Holdings Inc | 662.693 | 0,12 |
| 1.721 | Jack Henry & Associates Inc | 250.698 | 0,04 |
| 1.944 | JB Hunt Transport Services Inc | 227.020 | 0,04 |
| 2.501 | JM Smucker Co/The | 260.429 | 0,05 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 17.695 | Johnson Controls International plc | 720.363 | 0,13 |
| 71.713 | JPMorgan Chase & Co | 9.996.792 | 1,75 |
| 2.256 | Kansas City Southern | 345.529 | 0,06 |
| 7.786 | Kellogg Co | 538.480 | 0,09 |
| 6.088 | Keurig Dr Pepper Inc | 176.248 | 0,03 |
| 22.488 | KeyCorp | 455.157 | 0,08 |
| 4.318 | Keysight Technologies Inc | 443.156 | 0,08 |
| 7.867 | Kimberly-Clark Corp | 1.082.106 | 0,19 |
| 44.500 | Kinder Morgan Inc/DE | 942.065 | 0,17 |
| 11.946 | KKR & Co Inc | 348.465 | 0,06 |
| 3.617 | KLA Corp | 644.441 | 0,11 |
| 14.961 | Kraft Heinz Co/The | 480.697 | 0,08 |
| 18.292 | Kroger Co/The | 530.285 | 0,09 |
| 5.055 | L3Harris Technologies Inc | 1.000.233 | 0,18 |
| 2.204 | Laboratory Corp of America Holdings | 372.851 | 0,07 |
| 3.332 | Lam Research Corp | 974.277 | 0,17 |
| 3.341 | Lamb Weston Holdings Inc | 287.426 | 0,05 |
| 8.580 | Las Vegas Sands Corp | 592.363 | 0,10 |
| 3.230 | Leidos Holdings Inc | 316.185 | 0,06 |
| 1.945 | Lennar Corp | 86.941 | 0,02 |
| 5.077 | Lennar Corp | 283.246 | 0,05 |
| 3.408 | Liberty Broadband Corp | 428.556 | 0,08 |
| 502 | Liberty Broadband Corp | 62.529 | 0,01 |
| 46 | Liberty Media Corp-Liberty Braves | 1.364 | 0,00 |
| 769 | Liberty Media Corp-Liberty Braves | 22.716 | 0,00 |
| 5.050 | Liberty Media Corp-Liberty Formula One | 232.123 | 0,04 |
| 6.288 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM | 302.704 | 0,05 |
| 4.716 | Lincoln National Corp | 278.291 | 0,05 |
| 12.342 | Linde Plc | 2.627.612 | 0,46 |
| 3.211 | Live Nation Entertainment Inc | 229.490 | 0,04 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|-------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 6.948 | LKQ Corp | 248.044 | 0,04 |
| 5.802 | Loews Corp | 304.547 | 0,05 |
| 17.655 | Lowe's Cos Inc | 2.114.363 | 0,37 |
| 2.667 | Lululemon Athletica Inc | 617.864 | 0,11 |
| 4.746 | Lyft Inc | 204.173 | 0,04 |
| 5.905 | LyondellBasell Industries NV | 557.904 | 0,10 |
| 2.985 | M&T Bank Corp | 506.704 | 0,09 |
| 14.837 | Marathon Petroleum Corp | 893.929 | 0,16 |
| 308 | Markel Corp | 352.096 | 0,06 |
| 836 | MarketAxess Holdings Inc | 316.936 | 0,06 |
| 6.218 | Marriott International Inc/MD | 941.592 | 0,17 |
| 11.682 | Marsh & McLennan Cos Inc | 1.301.492 | 0,23 |
| 1.394 | Martin Marietta Materials Inc | 389.818 | 0,07 |
| 15.308 | Marvell Technology Group Ltd | 406.580 | 0,07 |
| 6.622 | Masco Corp | 317.790 | 0,06 |
| 20.408 | Mastercard Inc | 6.093.625 | 1,07 |
| 6.101 | Maxim Integrated Products Inc | 375.273 | 0,07 |
| 2.822 | McCormick & Co Inc/MD | 478.978 | 0,08 |
| 17.299 | McDonald's Corp | 3.418.455 | 0,60 |
| 4.147 | McKesson Corp | 573.613 | 0,10 |
| 12.017 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | 253.679 | 0,04 |
| 30.830 | Medtronic Plc | 3.497.663 | 0,61 |
| 1.009 | MercadoLibre Inc | 577.087 | 0,10 |
| 58.595 | Merck & Co Inc | 5.329.215 | 0,93 |
| 18.046 | MetLife Inc | 919.805 | 0,16 |
| 557 | Mettler-Toledo International Inc | 441.857 | 0,08 |
| 11.742 | MGM Resorts International | 390.656 | 0,07 |
| 5.394 | Microchip Technology Inc | 564.860 | 0,10 |
| 25.463 | Micron Technology Inc | 1.369.400 | 0,24 |
| 173.414 | Microsoft Corp | 27.347.388 | 4,79 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 2.539 | Mid-America Apartment Communities Inc (REIT) | 334.793 | 0,06 |
| 33.142 | Mondelez International Inc | 1.825.461 | 0,32 |
| 9.057 | Monster Beverage Corp | 575.572 | 0,10 |
| 4.337 | Moody's Corp | 1.029.647 | 0,18 |
| 28.328 | Morgan Stanley | 1.448.127 | 0,25 |
| 3.905 | Motorola Solutions Inc | 629.252 | 0,11 |
| 1.901 | MSCI Inc - Class A | 490.800 | 0,09 |
| 2.995 | Nasdaq Inc | 320.764 | 0,06 |
| 5.279 | NetApp Inc | 328.618 | 0,06 |
| 9.942 | Netflix Inc | 3.216.933 | 0,56 |
| 1.986 | Neurocrine Biosciences Inc | 213.475 | 0,04 |
| 18.650 | Newmont Goldcorp Corp | 810.342 | 0,14 |
| 11.256 | NextEra Energy Inc | 2.725.753 | 0,48 |
| 28.442 | NIKE Inc | 2.881.459 | 0,50 |
| 6.014 | Norfolk Southern Corp | 1.167.498 | 0,20 |
| 4.841 | Northern Trust Corp | 514.308 | 0,09 |
| 14.193 | NortonLifeLock Inc | 362.205 | 0,06 |
| 4.747 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | 277.272 | 0,05 |
| 6.792 | Nucor Corp | 382.254 | 0,07 |
| 13.534 | NVIDIA Corp | 3.184.550 | 0,56 |
| 80 | NVR Inc | 304.673 | 0,05 |
| 2.422 | Okta Inc | 279.426 | 0,05 |
| 1.607 | Old Dominion Freight Line Inc | 304.976 | 0,05 |
| 4.873 | Omnicom Group Inc | 394.810 | 0,07 |
| 9.363 | ONEOK Inc | 708.498 | 0,12 |
| 49.199 | Oracle Corp | 2.606.563 | 0,46 |
| 1.708 | O'Reilly Automotive Inc | 748.548 | 0,13 |
| 7.577 | PACCAR Inc | 599.341 | 0,11 |
| 2.169 | Packaging Corp of America | 242.906 | 0,04 |
| 2.191 | Palo Alto Networks Inc | 506.669 | 0,09 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 2.986 | Parker-Hannifin Corp | 614.579 | 0,11 |
| 7.269 | Paychex Inc | 618.301 | 0,11 |
| 1.127 | Paycom Software Inc | 298.385 | 0,05 |
| 27.082 | PayPal Holdings Inc | 2.929.460 | 0,51 |
| 32.066 | PepsiCo Inc | 4.382.460 | 0,77 |
| 127.487 | Pfizer Inc | 4.994.941 | 0,88 |
| 10.180 | Phillips 66 | 1.134.154 | 0,20 |
| 10.002 | PNC Financial Services Group Inc/The | 1.596.619 | 0,28 |
| 5.403 | PPG Industries Inc | 721.246 | 0,13 |
| 6.470 | Principal Financial Group Inc | 355.850 | 0,06 |
| 57.452 | Procter & Gamble Co/The | 7.175.755 | 1,26 |
| 13.502 | Progressive Corp/The | 977.410 | 0,17 |
| 14.561 | Prologis Inc (REIT) | 1.297.968 | 0,23 |
| 9.357 | Prudential Financial Inc | 877.125 | 0,15 |
| 11.527 | Public Service Enterprise Group Inc | 680.669 | 0,12 |
| 3.413 | Public Storage (REIT) | 726.832 | 0,13 |
| 5.883 | PulteGroup Inc | 228.260 | 0,04 |
| 2.645 | Qorvo Inc | 307.428 | 0,05 |
| 26.300 | QUALCOMM Inc | 2.320.449 | 0,41 |
| 3.043 | Quest Diagnostics Inc | 324.962 | 0,06 |
| 2.783 | Raymond James Financial Inc | 248.967 | 0,04 |
| 7.459 | Realty Income Corp (REIT) | 549.206 | 0,10 |
| 3.806 | Regency Centers Corp (REIT) | 240.121 | 0,04 |
| 1.886 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 708.155 | 0,12 |
| 22.032 | Regions Financial Corp | 378.069 | 0,07 |
| 7.211 | Republic Services Inc - Class A | 646.322 | 0,11 |
| 3.267 | ResMed Inc | 506.287 | 0,09 |
| 1.664 | RingCentral Inc - Class A | 280.667 | 0,05 |
| 2.671 | Rockwell Automation Inc | 541.332 | 0,09 |
| 2.098 | Roku Inc | 280.922 | 0,05 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|--|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 3.334 | Rollins Inc | 110.555 | 0,02 |
| 2.337 | Roper Technologies Inc | 827.836 | 0,15 |
| 8.086 | Ross Stores Inc | 941.372 | 0,17 |
| 3.909 | Royal Caribbean Cruises Ltd | 521.891 | 0,09 |
| 5.625 | S&P Global Inc | 1.535.906 | 0,27 |
| 19.620 | salesforce.com Inc | 3.190.997 | 0,56 |
| 2.585 | SBA Communications Corp (REIT) - Class A | 622.959 | 0,11 |
| 31.844 | Schlumberger Ltd | 1.280.129 | 0,22 |
| 6.990 | Sea Ltd ADR | 281.138 | 0,05 |
| 5.986 | Seagate Technology Plc | 356.167 | 0,06 |
| 3.934 | Seattle Genetics Inc | 449.499 | 0,08 |
| 6.480 | Sempra Energy | 981.590 | 0,17 |
| 4.317 | ServiceNow Inc | 1.218.775 | 0,21 |
| 1.905 | Sherwin-Williams Co/The | 1.111.644 | 0,19 |
| 7.114 | Simon Property Group Inc (REIT) | 1.059.701 | 0,19 |
| 27.489 | Sirius XM Holdings Inc | 196.546 | 0,03 |
| 3.897 | Skyworks Solutions Inc | 471.069 | 0,08 |
| 24.172 | Southern Co/The (Units) | 1.539.756 | 0,27 |
| 12.046 | Southwest Airlines Co | 650.243 | 0,11 |
| 3.594 | Splunk Inc | 538.273 | 0,09 |
| 2.956 | Spotify Technology SA | 442.070 | 0,08 |
| 15.037 | Sprint Corp | 78.343 | 0,01 |
| 7.954 | Square Inc | 497.602 | 0,09 |
| 5.097 | SS&C Technologies Holdings Inc | 312.956 | 0,05 |
| 3.531 | Stanley Black & Decker Inc | 585.228 | 0,10 |
| 26.163 | Starbucks Corp | 2.300.251 | 0,40 |
| 8.349 | State Street Corp | 660.406 | 0,12 |
| 1.915 | STERIS Plc | 291.884 | 0,05 |
| 7.957 | Stryker Corp | 1.670.493 | 0,29 |
| 2.067 | Sun Communities Inc (REIT) | 310.257 | 0,05 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|-----------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 1.209 | SVB Financial Group | 303.507 | 0,05 |
| 14.641 | Synchrony Financial | 527.222 | 0,09 |
| 3.420 | Synopsys Inc | 476.064 | 0,08 |
| 11.614 | Sysco Corp | 993.462 | 0,17 |
| 2.565 | Take-Two Interactive Software Inc | 314.033 | 0,06 |
| 11.616 | Target Corp | 1.489.287 | 0,26 |
| 11.394 | TD Ameritrade Holding Corp | 566.282 | 0,10 |
| 7.709 | TE Connectivity Ltd | 738.831 | 0,13 |
| 820 | Teledyne Technologies Inc | 284.163 | 0,05 |
| 1.056 | Teleflex Inc | 397.521 | 0,07 |
| 3.285 | Tesla Inc | 1.374.214 | 0,24 |
| 21.452 | Texas Instruments Inc | 2.752.077 | 0,48 |
| 9.252 | Thermo Fisher Scientific Inc | 3.005.697 | 0,53 |
| 2.733 | Tiffany & Co | 365.265 | 0,06 |
| 27.658 | TJX Cos Inc/The | 1.688.797 | 0,30 |
| 7.247 | T-Mobile US Inc | 568.310 | 0,10 |
| 2.696 | Tractor Supply Co | 251.914 | 0,04 |
| 1.195 | TransDigm Group Inc | 669.200 | 0,12 |
| 4.343 | TransUnion | 371.804 | 0,07 |
| 5.896 | Travelers Cos Inc/The | 807.457 | 0,14 |
| 17.463 | Truist Financial Corp | 983.516 | 0,17 |
| 2.891 | Twilio Inc - Class A | 284.127 | 0,05 |
| 17.189 | Twitter Inc | 550.907 | 0,10 |
| 854 | Tyler Technologies Inc | 256.217 | 0,05 |
| 6.624 | Tyson Foods Inc - Class A | 603.049 | 0,11 |
| 32.428 | Uber Technologies Inc | 964.409 | 0,17 |
| 208 | Ubiquiti Inc | 39.308 | 0,01 |
| 6.561 | UDR Inc (REIT) | 306.399 | 0,05 |
| 1.259 | Ulta Beauty Inc | 318.703 | 0,06 |
| 16.006 | Union Pacific Corp | 2.893.725 | 0,51 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|----------------------------------|-------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 5.789 | United Airlines Holdings Inc | 509.953 | 0,09 |
| 16.167 | United Parcel Service Inc - Class B | 1.892.509 | 0,33 |
| 1.768 | United Rentals Inc | 294.849 | 0,05 |
| 19.904 | United Technologies Corp | 2.980.823 | 0,52 |
| 21.699 | UnitedHealth Group Inc | 6.379.072 | 1,12 |
| 1.776 | Universal Health Services Inc | 254.785 | 0,04 |
| 35.758 | US Bancorp | 2.120.092 | 0,37 |
| 9.418 | Valero Energy Corp | 881.996 | 0,15 |
| 2.088 | Varian Medical Systems Inc | 296.517 | 0,05 |
| 3.069 | Veeva Systems Inc - Class A | 431.686 | 0,08 |
| 8.561 | Ventas Inc (REIT) | 494.312 | 0,09 |
| 2.701 | VeriSign Inc | 520.429 | 0,09 |
| 3.728 | Verisk Analytics Inc - Class A | 556.740 | 0,10 |
| 95.157 | Verizon Communications Inc | 5.842.640 | 1,02 |
| 5.905 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 1.292.900 | 0,23 |
| 9.221 | VF Corp | 918.965 | 0,16 |
| 12.432 | ViacomCBS Inc - Class B | 521.771 | 0,09 |
| 10.578 | VICI Properties Inc (REIT) | 270.268 | 0,05 |
| 39.448 | Visa Inc - Class A | 7.412.279 | 1,30 |
| 11.244 | Vistra Energy Corp | 258.500 | 0,05 |
| 1.781 | VMware Inc | 270.338 | 0,05 |
| 4.067 | Vornado Realty Trust (REIT) | 270.455 | 0,05 |
| 17.193 | Walgreens Boots Alliance Inc | 1.013.699 | 0,18 |
| 31.824 | Walmart Inc | 3.781.964 | 0,66 |
| 41.469 | Walt Disney Co/The | 5.997.661 | 1,05 |
| 9.733 | Waste Management Inc | 1.109.173 | 0,19 |
| 1.477 | Waters Corp | 345.101 | 0,06 |
| 1.139 | WellCare Health Plans Inc | 376.109 | 0,07 |
| 9.309 | Welltower Inc (REIT) | 761.290 | 0,13 |
| 1.672 | West Pharmaceutical Services Inc | 251.352 | 0,04 |

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung der Vermögenswerte (Fortsetzung)**

Zum 31. Dezember 2019

| Nominal | Beschreibung | Wert US\$ | % des Nettover- mögens |
|------------------------------------|--|--------------------|------------------------------|
| Stammaktien (Fortsetzung) | | | |
| 6.859 | Western Digital Corp | 435.341 | 0,08 |
| 9.521 | Western Union Co/The | 254.972 | 0,04 |
| 4.213 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | 327.771 | 0,06 |
| 17.365 | Weyerhaeuser Co (REIT) | 524.423 | 0,09 |
| 27.694 | Williams Cos Inc/The | 656.902 | 0,12 |
| 2.970 | Willis Towers Watson Plc | 599.762 | 0,11 |
| 3.824 | Workday Inc - Class A | 628.857 | 0,11 |
| 3.894 | WP Carey Inc (REIT) | 311.676 | 0,05 |
| 3.184 | WR Berkley Corp | 220.014 | 0,04 |
| 1.028 | WW Grainger Inc | 347.999 | 0,06 |
| 2.257 | Wynn Resorts Ltd | 313.430 | 0,06 |
| 5.779 | Xilinx Inc | 565.013 | 0,10 |
| 4.081 | Xylem Inc/NY | 321.542 | 0,06 |
| 8.628 | Yum China Holdings Inc | 414.230 | 0,07 |
| 6.878 | Yum! Brands Inc | 692.821 | 0,12 |
| 1.241 | Zebra Technologies Corp | 317.001 | 0,06 |
| 4.727 | Zimmer Biomet Holdings Inc | 707.537 | 0,12 |
| 10.937 | Zoetis Inc | 1.447.512 | 0,25 |
| | Stammaktien insgesamt | 570.095.282 | 99,88 |
| Gesamtanlagen | | | |
| | Stammaktien | 570.095.282 | 99,88 |
| | Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | 704.843 | 0,12 |
| | Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen | 570.800.125 | 100,00 |
| Analyse des Gesamtvermögens | | | % des Gesamtvermögens |
| | Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere | | 99,87 |
| | Sonstige Vermögenswerte | | 0,13 |
| | | | 100,00 |
| | Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben. | | |

* Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

Weitere Informationen

Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions)

Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 wurden vom Anlageverwalter im Namen der Gesellschaft keine Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen abgeschlossen.

Wechselkurse

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 31. Dezember 2019 und zum 30. Juni 2019 wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

| 31. Dezember 2019 | | | 30. Juni 2019 | | |
|-------------------|---|-----------|---------------|---|-----------|
| 1 \$ | = | 0,8909 € | 1 \$ | = | 0,8781 € |
| 1 \$ | = | 0,7549 £ | 1 \$ | = | 0,7857 £ |
| 1 € | = | 0,8473 £ | 1 € | = | 0,8948 £ |
| 1 € | = | 1,1225 \$ | 1 € | = | 1,1388 \$ |
| 1 £ | = | 1,1802 € | 1 £ | = | 1,1176 € |
| 1 £ | = | 1,3248 \$ | 1 £ | = | 1,2727 \$ |

Zur Umrechnung der Erträge und Aufwendungen aus Fremdwährungen zum 31. Dezember 2019 und zum 31. Dezember 2018 wurden die folgenden durchschnittlichen Wechselkurse verwendet:

| 31. Dezember 2019 | | | 31. Dezember 2018 | | |
|-------------------|---|-----------|-------------------|---|-----------|
| 1 \$ | = | 0,9011 € | 1 \$ | = | 0,8681 € |
| 1 \$ | = | 0,7938 £ | 1 \$ | = | 0,7724 £ |
| 1 € | = | 1,1360 £ | 1 € | = | 0,8897 £ |
| 1 € | = | 0,9011 \$ | 1 € | = | 1,1519 \$ |
| 1 £ | = | 0,8810 € | 1 £ | = | 1,1519 € |
| 1 £ | = | 0,7938 \$ | 1 £ | = | 1,2945 \$ |

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften

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 31. Dezember 2019 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 Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 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 Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 ging die Gesellschaft nur in Bezug auf die Fonds mit synthetischer Nachbildung Total Return Swaps (in diesem Abschluss als OTC-Swaps definiert) ein.

Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 erzielten die Fonds mit synthetischer Nachbildung Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften. Diese Erträge wurden vollständig an die jeweiligen Fonds mit synthetischer Nachbildung überwiesen und werden im Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, ab Seite 26 ausgewiesen.

II. Konzentrationsdaten

In den nachstehenden Tabellen sind die zehn größten Emittenten nach dem Wert der von den einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung per 31. Dezember 2019 im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) Sachsicherheiten aufgeführt:

| Sicherheitenemittent | Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten | | Sicherheitenemittent | Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten |
|---|---|--|--|---|
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | € | | L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | € |
| United Kingdom Gilt | 4.494.088 | | French Republic Government Bond OAT | 12.580.906 |
| French Republic Government Bond OAT | 4.488.490 | | United Kingdom Gilt | 12.503.784 |
| Kingdom of Belgium Government Bond | 4.480.815 | | Kingdom of Belgium Government Bond | 12.376.290 |
| Biffa Plc '144A' | 1.129.208 | | Telecom Italia SpA/Milano | 3.148.233 |
| EDP Renovaveis SA | 1.129.207 | | Porsche Automobil Holding SE - Preference | 2.996.814 |
| Spire Healthcare Group Plc '144A' | 1.129.204 | | EQT AB | 1.958.098 |
| Telecom Italia SpA/Milano | 1.129.126 | | Biffa Plc '144A' | 1.552.478 |
| Renewi Plc | 1.103.156 | | Spire Healthcare Group Plc '144A' | 1.471.294 |
| Gym Group Plc/The '144A' | 957.954 | | HeidelbergCement AG | 1.359.794 |
| Harworth Group Plc | 866.816 | | WhiteHorse Finance Inc | 1.227.173 |

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Fortsetzung)

II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

| Sicherheitenemittent | Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten | Sicherheitenemittent | Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten |
|--|---|---|---|
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | \$ | L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | £ |
| HSBC Holdings Plc | 28.188.368 | French Republic Government Bond OAT | 1.960.797 |
| Ubisoft Entertainment SA | 28.188.304 | United Kingdom Gilt | 1.958.123 |
| Porsche Automobil Holding SE - Preference | 27.155.163 | Kingdom of Belgium Government Bond | 1.746.448 |
| BHP Group Plc | 27.144.826 | Biffa Plc '144A' | 492.029 |
| Eiffage SA | 24.302.540 | Gym Group Plc/The '144A' | 492.027 |
| Tesco Plc | 23.067.004 | Renewi Plc | 492.022 |
| BP Plc | 19.612.107 | Spire Healthcare Group Plc '144A' | 492.021 |
| M&G Plc | 19.242.196 | Harworth Group Plc | 492.018 |
| Bureau Veritas SA | 18.888.382 | Telecom Italia SpA/Milano | 491.943 |
| GNI Group Ltd | 16.783.167 | Cairn Homes Plc | 487.811 |
| L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | £ | L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | \$ |
| Kingdom of Belgium Government Bond | 2.326.490 | Demae-Can Co Ltd | 2.885.486 |
| United Kingdom Gilt | 2.325.813 | Suedzucker AG | 2.885.474 |
| French Republic Government Bond OAT | 1.996.465 | Bilfinger SE | 2.885.461 |
| Mixi Inc | 584.408 | SCOR SE | 2.885.461 |
| Spire Healthcare Group Plc '144A' | 584.406 | Vodafone Group Plc | 2.885.447 |
| Harworth Group Plc | 584.405 | Continental AG | 2.885.400 |
| Cairn Homes Plc | 584.403 | Innogy SE '144A' | 2.885.321 |
| EDP Renovaveis SA | 584.403 | Barclays Plc | 2.885.055 |
| Biffa Plc '144A' | 584.402 | British American Tobacco Plc | 2.884.809 |
| Gym Group Plc/The '144A' | 584.401 | Moneysupermarket.com Group Plc | 2.842.961 |
| L&G Gold Mining UCITS ETF | \$ | L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | \$ |
| Eiffage SA | 10.758.513 | French Republic Government Bond OAT | 3.169.275 |
| Sophos Group Plc '144A' | 10.758.408 | United Kingdom Gilt | 3.164.844 |
| Barclays Plc | 10.758.144 | Kingdom of Belgium Government Bond | 3.155.556 |
| Allianz SE | 10.576.758 | Biffa Plc '144A' | 795.234 |
| Quilter Plc '144A' | 10.249.586 | Harworth Group Plc | 795.228 |
| Wacker Chemie AG | 7.865.233 | Spire Healthcare Group Plc '144A' | 795.224 |
| Nippon Paint Holdings Co Ltd | 7.199.756 | Renewi Plc | 795.220 |
| Trainline Plc '144A' | 6.523.158 | EDP Renovaveis SA | 795.216 |
| Investec Plc | 5.617.443 | Cairn Homes Plc | 795.205 |
| Rozetta Corp | 5.325.979 | Jungheinrich AG - Preference | 589.222 |

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Fortsetzung)

II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

| Sicherheitenemittent | Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten | Sicherheitenemittent | Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten |
|---|---|--|---|
| L&G All Commodities UCITS ETF | \$ | L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF | \$ |
| HSBC Holdings Plc | 2.644.999 | AA Plc | 422.727 |
| Investec Plc | 2.644.993 | Godewind Immobilien AG '144A' | 422.723 |
| Eiffage SA | 2.644.983 | New Art Holdings Co Ltd | 422.721 |
| Bureau Veritas SA | 2.644.950 | Nichirin Co Ltd | 422.719 |
| comdirect bank AG | 2.644.950 | HAL Trust | 422.711 |
| Ubisoft Entertainment SA | 2.644.872 | comdirect bank AG | 422.700 |
| Altran Technologies SA | 2.644.784 | Bureau Veritas SA | 422.682 |
| ConvaTec Group Plc '144A' | 2.615.871 | Altran Technologies SA | 422.660 |
| Porsche Automobil Holding SE - Preference | 2.595.807 | HSBC Holdings Plc | 422.632 |
| Grifols SA - Preference | 2.216.960 | Ubisoft Entertainment SA | 422.626 |

Die nachstehenden Tabellen liefern eine Währungsanalyse der von den einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung per 31. Dezember 2019 im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) Sachsicherheiten:

| Währung | | Währung | |
|---|--------------------|--|--------------------|
| L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF | € | L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF | £ |
| Euro | 11.351.571 | Euro | 5.824.373 |
| Japanischer Yen | 2.334.997 | Japanischer Yen | 664.711 |
| Britisches Pfund | 9.960.183 | Britisches Pfund | 5.247.975 |
| Schwedische Krone | 94 | US-Dollar | 478.304 |
| | 23.646.845 | | 12.215.363 |
| L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF | € | L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | \$ |
| Euro | 33.658.330 | Australischer Dollar | 1.272.392 |
| Japanischer Yen | 6.573.694 | Euro | 33.045.835 |
| Britisches Pfund | 20.569.280 | Japanischer Yen | 14.410.967 |
| Schwedische Krone | 1.958.097 | Britisches Pfund | 13.848.975 |
| US-Dollar | 2.819.035 | | |
| | 65.578.436 | | 62.578.169 |
| L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF | \$ | L&G Gold Mining UCITS ETF | \$ |
| Australischer Dollar | 3.091.891 | Australischer Dollar | 3.207.921 |
| Kanadischer Dollar | 127.954 | Euro | 121.053.286 |
| Euro | 303.014.973 | Japanischer Yen | 53.776.636 |
| Japanischer Yen | 140.941.829 | Norwegische Krone | 15.040 |
| Norwegische Krone | 8.516.786 | Britisches Pfund | 53.792.950 |
| Britisches Pfund | 140.941.338 | Schwedische Krone | 264.066 |
| Südafrikanischer Rand | 1.089.230 | | 232.109.899 |
| Schweizer Franken | 4.923.795 | | |
| US-Dollar | 4.376.649 | | |
| | 607.024.445 | | |

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Fortsetzung)

II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

| Währung | | Währung | |
|---|-------------------|---|-------------------|
| L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF | £ | L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF | \$ |
| Euro | 4.863.722 | Euro | 8.504.474 |
| Japanischer Yen | 543.537 | Japanischer Yen | 959.597 |
| Britisches Pfund | 4.418.441 | Britisches Pfund | 7.141.250 |
| US-Dollar | 439.975 | | 16.605.321 |
| | 10.265.675 | | |
| | | L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UC | \$ |
| L&G All Commodities UCITS ETF | \$ | Euro | 5.062.536 |
| Euro | 31.108.347 | Japanischer Yen | 2.113.635 |
| Japanischer Yen | 13.224.888 | Britisches Pfund | 2.035.911 |
| Norwegische Krone | 42.036 | | 9.212.082 |
| Britisches Pfund | 12.986.397 | | |
| US-Dollar | 272.526 | | |
| | 57.634.194 | | |

Nähere Angaben zu für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltene Sicherheiten und Barsicherheiten, die von/bei Swap-Kontrahenten hinterlegt wurden, finden Sie in Anmerkung 5.

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Fortsetzung)

III. Transaktionsdaten

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der entgegengenommenen Sicherheiten für die umgekehrten Pensionsgeschäfte per 31. Dezember 2019:

| Fälligkeitsprofil | L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten € | L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten € | L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten \$ | L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten £ | L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten £ | L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten \$ | L&G Gold Mining UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten \$ | L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF 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 | - | 4.524.081 | - | - | 1.996.465 | - | - | 3.169.276 |
| Mehr als ein Jahr | 13.463.577 | 32.936.900 | - | 5.837.974 | 4.985.042 | - | - | 6.320.587 |
| Offene Fälligkeit | 10.183.268 | 28.117.455 | 607.024.445 | 4.427.701 | 5.233.856 | 62.578.169 | 232.109.899 | 7.115.458 |
| | 23.646.845 | 65.578.436 | 607.024.445 | 10.265.675 | 12.215.363 | 62.578.169 | 232.109.899 | 16.605.321 |

| Fälligkeitsprofil | L&G All Commodities UCITS ETF ¹ Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten \$ | L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF ¹ 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 | - | - |
| Offene Fälligkeit | 57.634.194 | 9.212.082 |
| | 57.634.194 | 9.212.082 |

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Fortsetzung)

III. Transaktionsdaten (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2019:

| Fälligkeitsprofil | L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF Zeitwert € | L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF Zeitwert € | L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF Zeitwert \$ | L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF Zeitwert £ | L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF Zeitwert £ | L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF Zeitwert \$ | L&G Gold Mining UCITS ETF Zeitwert \$ | L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF Zeitwert \$ |
|--------------------------|---|--|--|---|--|---|---|--|
| Weniger als ein Tag | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | 22.709.130 | 63.314.000 | 563.767.449 | 9.959.000 | 11.828.751 | 57.709.750 | 215.171.799 | 15.904.700 |
| Ein bis drei Monate | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Offene Fälligkeit | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 22.709.130 | 63.314.000 | 563.767.449 | 9.959.000 | 11.828.751 | 57.709.750 | 215.171.799 | 15.904.700 |

| Fälligkeitsprofil | L&G All Commodities UCITS ETF Zeitwert \$ | L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF Zeitwert \$ |
|--------------------------|---|---|
| Weniger als ein Tag | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | 52.900.070 | 8.454.553 |
| Ein bis drei Monate | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - |
| Offene Fälligkeit | - | - |
| | 52.900.070 | 8.454.553 |

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Fortsetzung)

III. Transaktionsdaten (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der OTC-Swap-Transaktionen zum 31. Dezember 2019:

| Marktwerte - OTC-Swap-Transaktionen | L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust | L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust | L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust | L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust | L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust | L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust | L&G Gold Mining UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust | L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust |
|-------------------------------------|--|---|--|--|---|---|---|--|
| | € | € | \$ | £ | £ | \$ | \$ | \$ |
| Weniger als ein Tag | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | (254.622) | 665.317 | 5.024.747 | (96.204) | 118.088 | (93.802) | 17.871.410 | 1.682.131 |
| Ein bis drei Monate | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Offene Fälligkeit | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | (254.622) | 665.317 | 5.024.747 | (96.204) | 118.088 | (93.802) | 17.871.410 | 1.682.131 |

| Marktwerte - OTC-Swap-Transaktionen | L&G All Commodities UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust | L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF Nicht realisierter Gewinn/Verlust |
|-------------------------------------|---|---|
| | \$ | \$ |
| Weniger als ein Tag | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | 369.464 | 41.347 |
| Ein bis drei Monate | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - |
| Offene Fälligkeit | - | - |
| | 369.464 | 41.347 |

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Fortsetzung)

III. Transaktionsdaten (Fortsetzung)

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. Kreditrisiko „(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“ in Anmerkung 11 in diesem Abschluss.

Einzelheiten zur Wiederverwendung von Sicherheiten entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „3. C. „(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“ in Anmerkung 11 in diesem Abschluss.

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.

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 für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhaltenen Sicherheiten sind Anmerkung 5 („Sicherheiten“) zu entnehmen.

Festverzinsliche Wertpapiere

Staatsanleihen und supranationale Anleihen müssen ein langfristiges Kreditrating von mindestens AA bzw. AAA (Standard & Poor's) haben. Die Fälligkeit einer Staatsanleihe oder supranationalen Anleihe ist kein Kriterium für die Auswahl, sie ist jedoch für die Bestimmung des entsprechenden Bewertungsabschlags maßgeblich, der zwischen 0 % und 2 % liegt. Für die einzelnen Fonds gilt eine Konzentrationsbeschränkung von 20 % in Bezug auf jeden Emittenten (bei Staatsanleihen gilt die Beschränkung der Emittentenkonzentration je Emissionsland).

Aktien

Aktienwerte können nur dann als Sicherheiten übertragen werden, wenn sie eine Komponente eines in der Aufstellung der zulässigen Sicherheiten genannten bestimmten Index sind. Zusätzlich finden abhängig vom Index, in dem der Aktienwert enthalten ist, Bewertungsabschläge zwischen 5 % und 10 % Anwendung. Für die einzelnen Fonds gilt eine Konzentrationsbeschränkung von 5 % in Bezug auf jeden Emittenten sowie eine weitere Konzentrationsbeschränkung je Gründungsland der Emittenten, wobei diese Länderkonzentrationsbeschränkung je nach Gründungsland variiert. Letztlich darf kein Fonds mehr als 2,5 % der Marktkapitalisierung je Wertpapier und höchstens 100 % des 30-tägigen Durchschnitts des täglich gehandelten Werts je Wertpapier halten.

Als Sicherheiten dienende Wertpapiere, die vom jeweiligen Repo-Kontrahenten emittiert wurden, kommen nicht für eine Aufnahme infrage.

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

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 Berichtszeitraums übersteigen. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe angegeben werden.

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|----------------|
| 11.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A' | 137.103 |
| 17.200 | Wanhua Chemical Group Co Ltd 'A' | 120.555 |
| 9.100 | Contemporary Ampere Technology Co Ltd 'A' | 113.483 |
| 500 | Kweichow Moutai Co Ltd 'A' | 75.505 |
| 5.800 | WuXi AppTec Co Ltd 'A' | 74.431 |
| 13.700 | China Merchants Bank Co Ltd 'A' | 68.522 |
| 15.400 | Yonyou Network Technology Co Ltd 'A' | 68.270 |
| 81.400 | China Railway Group Ltd 'A' | 67.054 |
| 24.100 | China Yangtze Power Co Ltd 'A' | 61.986 |
| 19.400 | Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd 'A' | 57.027 |
| 2.200 | Gigadevice Semiconductor Beijing Inc 'A' | 50.396 |
| 15.800 | Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd 'A' | 45.527 |
| 17.700 | Industrial Bank Co Ltd 'A' | 45.504 |
| 13.700 | Yango Group Co Ltd 'A' | 45.376 |
| 63.000 | Focus Media Information Technology Co Ltd 'A' | 45.318 |
| 8.900 | Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co Ltd 'A' | 37.809 |
| 31.800 | Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd 'A' | 37.318 |
| 155.600 | Hainan Airlines Holding Co Ltd 'A' | 37.233 |
| 1.900 | Wuliangye Yibin Co Ltd 'A' | 34.869 |
| 3.400 | Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd 'A' | 34.556 |
| 34.300 | Wuhu Token Science Co Ltd 'A' | 34.433 |
| 4.600 | Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai 'A' | 34.409 |
| 19.700 | Zhejiang Crystal-Optech Co Ltd 'A' | 34.300 |
| 21.200 | Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd 'A' | 34.292 |
| 4.700 | Midea Group Co Ltd 'A' | 34.281 |
| 13.900 | Qingdao TGOOD Electric Co Ltd 'A' | 34.270 |
| 19.500 | Centre Testing International Group Co Ltd 'A' | 34.226 |
| 6.100 | Anhui Conch Cement Co Ltd 'A' | 34.225 |
| 16.000 | Siasun Robot & Automation Co Ltd 'A' | 34.197 |
| 10.600 | CITIC Securities Co Ltd 'A' | 34.193 |
| 9.200 | Songcheng Performance Development Co Ltd 'A' | 34.188 |
| 7.600 | Shanghai Baosight Software Co Ltd 'A' | 34.119 |

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--|----------------|
| 600 | Kweichow Moutai Co Ltd 'A' | 100.200 |
| 9.700 | Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd 'A' | 96.084 |
| 17.300 | China Merchants Bank Co Ltd 'A' | 87.045 |
| 5.100 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A' | 64.401 |
| 24.700 | Industrial Bank Co Ltd 'A' | 63.307 |
| 6.700 | Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai 'A' | 55.118 |
| 29.800 | Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd 'A' | 50.343 |
| 56.600 | China Minsheng Banking Corp Ltd 'A' | 49.554 |
| 13.000 | Tianqi Lithium Corp 'A' | 49.212 |
| 5.500 | Midea Group Co Ltd 'A' | 44.242 |
| 2.500 | Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A' | 39.231 |
| 11.700 | CITIC Securities Co Ltd 'A' | 38.376 |
| 36.100 | China Construction Bank Corp 'A' | 37.116 |
| 19.100 | Siasun Robot & Automation Co Ltd 'A' | 37.030 |
| 16.800 | Ping An Bank Co Ltd 'A' | 36.988 |
| 10.600 | Fiberhome Telecommunication Technologies Co Ltd 'A' | 36.904 |
| 24.200 | SooChow Securities Co Ltd 'A' | 35.994 |
| 4.100 | Anhui Kouzi Distillery Co Ltd 'A' | 35.917 |
| 1.700 | Wuliangye Yibin Co Ltd 'A' | 31.348 |
| 24.000 | Zhongjin Gold Corp Ltd 'A' | 27.264 |
| 9.300 | China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd 'A' | 25.897 |
| 17.300 | Suning.com Co Ltd 'A' | 25.737 |
| 5.000 | Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'A' | 25.659 |
| 6.800 | China Vanke Co Ltd 'A' | 25.626 |
| 11.300 | Jilin Aodong Pharmaceutical Group Co Ltd 'A' | 25.607 |
| 26.900 | Bank of Jiangsu Co Ltd 'A' | 25.566 |
| 2.200 | Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd 'A' | 25.533 |
| 6.300 | Shengyi Technology Co Ltd 'A' | 25.449 |
| 3.600 | BYD Co Ltd 'A' | 25.360 |
| 5.300 | Iflytek Co Ltd 'A' | 24.823 |
| 18.800 | Bank of Shanghai Co Ltd 'A' | 24.762 |
| 47.600 | Bank of China Ltd 'A' | 24.736 |
| 29.700 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A' | 24.730 |
| 30.800 | Shanghai International Port Group Co Ltd 'A' | 24.663 |
| 31.200 | Bank of Communications Co Ltd 'A' | 24.652 |
| 5.900 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A' | 24.644 |

G E Fund MSCI China A UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe (Fortsetzung)**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--|----------------|
| 10.900 | AVIC Aircraft Co Ltd 'A' | 24.640 |
| 4.700 | Beijing Shiji Information Technology Co Ltd 'A' | 24.614 |
| 26.300 | Baoshan Iron & Steel Co Ltd 'A' | 24.024 |
| 25.800 | Huaneng Power International Inc 'A' | 24.017 |
| 19.300 | Oriental Energy Co Ltd 'A' | 24.002 |
| 17.800 | Shanghai AJ Group Co Ltd 'A' | 23.955 |
| 17.000 | Beijing Gehua CATV Network Co Ltd 'A' | 23.954 |
| 27.800 | China United Network Communications Ltd 'A' | 23.941 |
| 30.200 | Beijing Dabeinong Technology Group Co Ltd 'A' | 23.939 |
| 16.700 | Oriental Pearl Group Co Ltd 'A' | 23.912 |
| 21.500 | Financial Street Holdings Co Ltd 'A' | 23.898 |
| 14.400 | Zhejiang Medicine Co Ltd 'A' | 23.896 |
| 28.400 | Shanghai Dazhong Public Utilities Group Co Ltd 'A' | 23.878 |
| 18.100 | Sichuan Chuantou Energy Co Ltd 'A' | 23.828 |

L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten € |
|------------|----------------------------------|----------|--------------------|------------|
| 28.119.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 28.119.515 |
| 26.140.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,40) % | 23.07.2019 | 26.140.515 |
| 25.954.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 22.01.2020 | 25.954.130 |
| 25.678.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 25.678.130 |
| 25.568.439 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 25.568.439 |
| 24.844.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 24.844.515 |
| 24.314.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 24.314.130 |
| 23.403.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 23.403.130 |
| 22.989.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 22.989.130 |
| 22.919.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 22.919.515 |
| 22.827.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 22.827.130 |
| 22.709.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 22.01.2020 | 22.709.130 |
| 22.383.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 22.383.130 |
| 21.284.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 21.284.515 |
| 20.308.439 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 20.308.439 |
| 19.252.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 19.252.130 |
| 19.204.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 19.204.130 |
| 17.838.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 17.838.130 |
| 17.267.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 17.267.130 |
| 16.903.439 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 16.903.439 |
| 16.052.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 16.052.130 |
| 15.619.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 15.619.130 |

L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse € |
|------------|----------------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 30.435.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,40) % | 23.07.2019 | 30.435.515 |
| 28.119.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 28.119.515 |
| 26.140.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,40) % | 23.07.2019 | 26.140.515 |
| 25.954.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 22.01.2020 | 25.954.130 |
| 25.678.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 25.678.130 |
| 25.568.439 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 25.568.439 |
| 24.844.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 24.844.515 |
| 24.314.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 24.314.130 |
| 23.403.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 23.403.130 |
| 22.989.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 22.989.130 |
| 22.919.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 22.919.515 |
| 22.827.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 22.827.130 |
| 22.383.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 22.383.130 |
| 21.284.515 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 21.284.515 |
| 20.308.439 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 20.308.439 |
| 19.252.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 19.252.130 |
| 19.204.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 19.204.130 |
| 17.838.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 17.838.130 |
| 17.267.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 17.267.130 |
| 16.903.439 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 16.903.439 |
| 16.052.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 16.052.130 |
| 15.619.130 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 15.619.130 |

L&G DAX Daily 2x Short UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten € |
|------------|----------------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 72.472.841 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 72.472.841 |
| 71.540.981 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 71.540.981 |
| 68.497.841 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 68.497.841 |
| 68.005.981 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 68.005.981 |
| 66.865.967 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 66.865.967 |
| 66.014.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 66.014.000 |
| 65.813.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 65.813.000 |
| 64.880.981 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 64.880.981 |
| 63.495.967 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 63.495.967 |
| 63.314.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 22.01.2020 | 63.314.000 |
| 63.155.481 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 63.155.481 |
| 63.129.481 | Citigroup Global Markets Limited | (0,40) % | 23.07.2019 | 63.129.481 |
| 62.229.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 62.229.000 |
| 61.665.981 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 61.665.981 |
| 58.435.967 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 58.435.967 |
| 55.275.967 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 55.275.967 |
| 5.165.453 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 5.165.453 |
| 5.065.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 5.065.000 |
| 3.876.421 | Citigroup Global Markets Limited | (0,47) % | 23.10.2019 | 3.876.421 |
| 2.793.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 2.793.000 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse € |
|------------|----------------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 72.472.841 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 72.472.841 |
| 71.540.981 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 71.540.981 |
| 68.497.841 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 68.497.841 |
| 68.005.981 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 68.005.981 |
| 66.865.967 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 66.865.967 |
| 66.014.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 66.014.000 |
| 65.813.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,44) % | 22.11.2019 | 65.813.000 |
| 65.524.481 | Citigroup Global Markets Limited | (0,40) % | 23.07.2019 | 65.524.481 |
| 64.880.981 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 64.880.981 |
| 63.495.967 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 63.495.967 |
| 63.155.481 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 22.08.2019 | 63.155.481 |
| 63.129.481 | Citigroup Global Markets Limited | (0,40) % | 23.07.2019 | 63.129.481 |
| 62.229.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,46) % | 24.12.2019 | 62.229.000 |
| 61.665.981 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 61.665.981 |
| 58.435.967 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 58.435.967 |
| 55.275.967 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 55.275.967 |
| 5.165.453 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 5.165.453 |
| 5.065.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,45) % | 23.10.2019 | 5.065.000 |
| 3.876.421 | Citigroup Global Markets Limited | (0,47) % | 23.10.2019 | 3.876.421 |
| 2.793.000 | Citigroup Global Markets Limited | (0,41) % | 24.09.2019 | 2.793.000 |

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten US\$ |
|-------------|-------------------|----------|--------------------|-------------|
| 562.716.449 | Barclays Bank Plc | 1,81 % | 23.01.2020 | 562.716.449 |
| 533.589.365 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 533.589.365 |
| 528.168.449 | Barclays Bank Plc | 2,07 % | 23.10.2019 | 528.168.449 |
| 512.844.365 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 512.844.365 |
| 512.844.365 | Barclays Bank Plc | 2,21 % | 24.09.2019 | 512.844.365 |
| 512.812.449 | Barclays Bank Plc | 1,75 % | 24.12.2019 | 512.812.449 |
| 510.862.449 | Barclays Bank Plc | 1,86 % | 22.11.2019 | 510.862.449 |
| 509.335.365 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 509.335.365 |
| 507.933.449 | Barclays Bank Plc | 2,07 % | 23.10.2019 | 507.933.449 |
| 45.419.000 | Barclays Bank Plc | 1,77 % | 24.12.2019 | 45.419.000 |
| 3.461.000 | Barclays Bank Plc | 1,78 % | 24.12.2019 | 3.461.000 |
| 1.707.000 | Barclays Bank Plc | 2,08 % | 24.09.2019 | 1.707.000 |
| 1.451.000 | Barclays Bank Plc | 2,41 % | 23.07.2019 | 1.451.000 |
| 1.275.000 | Barclays Bank Plc | 2,41 % | 23.07.2019 | 1.275.000 |
| 1.051.000 | Barclays Bank Plc | 1,81 % | 23.01.2020 | 1.051.000 |
| 1.030.000 | Barclays Bank Plc | 2,05 % | 23.10.2019 | 1.030.000 |
| 1.030.000 | Barclays Bank Plc | 2,05 % | 23.10.2019 | 1.030.000 |
| 1.024.000 | Barclays Bank Plc | 1,74 % | 24.12.2019 | 1.024.000 |
| 1.012.000 | Barclays Bank Plc | 1,76 % | 22.11.2019 | 1.012.000 |
| 956.000 | Barclays Bank Plc | 1,93 % | 23.10.2019 | 956.000 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse US\$ |
|-------------|-------------------|----------|--------------------|-------------|
| 533.589.365 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 533.589.365 |
| 530.070.365 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 530.070.365 |
| 528.168.449 | Barclays Bank Plc | 2,07 % | 23.10.2019 | 528.168.449 |
| 512.844.365 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 512.844.365 |
| 512.844.365 | Barclays Bank Plc | 2,21 % | 24.09.2019 | 512.844.365 |
| 512.812.449 | Barclays Bank Plc | 1,75 % | 24.12.2019 | 512.812.449 |
| 510.862.449 | Barclays Bank Plc | 1,86 % | 22.11.2019 | 510.862.449 |
| 509.335.365 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 509.335.365 |
| 507.933.449 | Barclays Bank Plc | 2,07 % | 23.10.2019 | 507.933.449 |
| 45.419.000 | Barclays Bank Plc | 1,77 % | 24.12.2019 | 45.419.000 |
| 8.856.000 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 8.856.000 |
| 3.976.000 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 3.976.000 |
| 3.461.000 | Barclays Bank Plc | 1,78 % | 24.12.2019 | 3.461.000 |
| 3.078.000 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 3.078.000 |
| 2.585.000 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 2.585.000 |
| 1.707.000 | Barclays Bank Plc | 2,08 % | 24.09.2019 | 1.707.000 |
| 1.451.000 | Barclays Bank Plc | 2,41 % | 23.07.2019 | 1.451.000 |
| 1.275.000 | Barclays Bank Plc | 2,41 % | 23.07.2019 | 1.275.000 |
| 1.158.000 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 1.158.000 |
| 1.030.000 | Barclays Bank Plc | 2,05 % | 23.10.2019 | 1.030.000 |

L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten £ |
|-----------|----------------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 9.959.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.01.2020 | 9.959.000 |
| 8.537.356 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 8.537.356 |
| 8.177.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 8.177.000 |
| 6.867.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 6.867.000 |
| 6.822.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 6.822.000 |
| 6.128.356 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 6.128.356 |
| 5.733.356 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 5.733.356 |
| 5.697.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 5.697.000 |
| 5.686.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 5.686.924 |
| 5.602.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 5.602.000 |
| 5.306.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 5.306.924 |
| 5.236.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 5.236.924 |
| 5.026.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 5.026.924 |
| 5.017.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 5.017.000 |
| 2.636.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 2.636.924 |
| 2.331.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 2.331.924 |
| 2.096.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 2.096.924 |
| 2.066.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.08.2019 | 2.066.000 |
| 1.881.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 1.881.924 |
| 1.880.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.12.2019 | 1.880.000 |
| 1.608.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 1.608.000 |
| 1.429.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 1.429.000 |

L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse £ |
|-----------|----------------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 8.537.356 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 8.537.356 |
| 8.177.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 8.177.000 |
| 6.867.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 6.867.000 |
| 6.822.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 6.822.000 |
| 6.128.356 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 6.128.356 |
| 5.733.356 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 5.733.356 |
| 5.697.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 5.697.000 |
| 5.686.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 23.07.2019 | 5.686.924 |
| 5.686.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 5.686.924 |
| 5.602.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 5.602.000 |
| 5.306.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 5.306.924 |
| 5.236.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 5.236.924 |
| 5.026.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 5.026.924 |
| 5.017.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 5.017.000 |
| 2.636.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 2.636.924 |
| 2.331.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 2.331.924 |
| 2.096.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 2.096.924 |
| 2.066.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.08.2019 | 2.066.000 |
| 1.881.924 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 1.881.924 |
| 1.880.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.12.2019 | 1.880.000 |
| 1.608.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 1.608.000 |
| 1.429.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 1.429.000 |

L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten £ |
|------------|----------------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 14.745.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 14.745.737 |
| 13.980.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 13.980.737 |
| 13.775.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 13.775.751 |
| 13.466.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 13.466.751 |
| 13.285.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 13.285.737 |
| 13.185.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 13.185.737 |
| 12.595.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 12.595.737 |
| 12.320.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 12.320.751 |
| 12.266.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 12.266.751 |
| 12.225.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 23.07.2019 | 12.225.737 |
| 11.760.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 11.760.751 |
| 11.745.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 11.745.751 |
| 11.521.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 11.521.751 |
| 11.498.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.01.2020 | 11.498.751 |
| 11.110.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 11.110.737 |
| 10.561.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 10.561.751 |
| 1.890.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.08.2019 | 1.890.000 |
| 1.125.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.11.2019 | 1.125.000 |
| 1.015.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 1.015.000 |
| 939.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 23.07.2019 | 939.000 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse £ |
|------------|----------------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 14.745.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 14.745.737 |
| 13.980.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 13.980.737 |
| 13.775.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 13.775.751 |
| 13.466.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 13.466.751 |
| 13.285.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 13.285.737 |
| 13.185.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 13.185.737 |
| 12.810.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 23.07.2019 | 12.810.737 |
| 12.595.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 12.595.737 |
| 12.320.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 12.320.751 |
| 12.266.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 12.266.751 |
| 12.225.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 23.07.2019 | 12.225.737 |
| 11.760.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.11.2019 | 11.760.751 |
| 11.745.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 23.10.2019 | 11.745.751 |
| 11.521.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 11.521.751 |
| 11.110.737 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.08.2019 | 11.110.737 |
| 10.561.751 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 24.12.2019 | 10.561.751 |
| 1.890.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 22.08.2019 | 1.890.000 |
| 1.125.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 22.11.2019 | 1.125.000 |
| 1.015.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,71 % | 24.09.2019 | 1.015.000 |
| 939.000 | Citigroup Global Markets Limited | 0,72 % | 23.07.2019 | 939.000 |

L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten US\$ |
|------------|-----------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 57.709.750 | Merrill Lynch International | 1,78 % | 23.01.2020 | 57.709.750 |
| 53.947.750 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 53.947.750 |
| 52.242.750 | Merrill Lynch International | 1,82 % | 22.11.2019 | 52.242.750 |
| 50.718.021 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 50.718.021 |
| 49.413.750 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 49.413.750 |
| 49.223.021 | Merrill Lynch International | 2,23 % | 22.08.2019 | 49.223.021 |
| 47.368.750 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 47.368.750 |
| 47.023.021 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 47.023.021 |
| 46.798.021 | Merrill Lynch International | 2,23 % | 22.08.2019 | 46.798.021 |
| 44.628.021 | Merrill Lynch International | 2,23 % | 22.08.2019 | 44.628.021 |
| 2.755.000 | Merrill Lynch International | 2,34 % | 23.07.2019 | 2.755.000 |
| 2.305.000 | Merrill Lynch International | 1,93 % | 23.10.2019 | 2.305.000 |
| 1.645.000 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 1.645.000 |
| 1.480.000 | Merrill Lynch International | 0,72 % | 22.08.2019 | 1.480.000 |
| 1.412.000 | Merrill Lynch International | 2,16 % | 22.08.2019 | 1.412.000 |
| 1.410.000 | Merrill Lynch International | 2,23 % | 22.08.2019 | 1.410.000 |
| 962.000 | Merrill Lynch International | 1,74 % | 24.12.2019 | 962.000 |
| 924.000 | Merrill Lynch International | 1,94 % | 23.10.2019 | 924.000 |
| 911.000 | Barclays Bank Plc | 2,34 % | 23.07.2019 | 911.000 |
| 906.000 | Barclays Bank Plc | 2,24 % | 22.08.2019 | 906.000 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse US\$ |
|------------|-----------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 53.947.750 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 53.947.750 |
| 52.242.750 | Merrill Lynch International | 1,82 % | 22.11.2019 | 52.242.750 |
| 50.718.021 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 50.718.021 |
| 49.413.750 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 49.413.750 |
| 49.223.021 | Merrill Lynch International | 2,23 % | 22.08.2019 | 49.223.021 |
| 47.368.750 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 47.368.750 |
| 47.023.021 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 47.023.021 |
| 46.798.021 | Merrill Lynch International | 2,23 % | 22.08.2019 | 46.798.021 |
| 45.557.021 | Merrill Lynch International | 2,37 % | 23.07.2019 | 45.557.021 |
| 44.628.021 | Merrill Lynch International | 2,23 % | 22.08.2019 | 44.628.021 |
| 2.755.000 | Merrill Lynch International | 2,34 % | 23.07.2019 | 2.755.000 |
| 2.305.000 | Merrill Lynch International | 1,93 % | 23.10.2019 | 2.305.000 |
| 1.645.000 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 1.645.000 |
| 1.480.000 | Merrill Lynch International | 0,72 % | 22.08.2019 | 1.480.000 |
| 1.412.000 | Merrill Lynch International | 2,16 % | 22.08.2019 | 1.412.000 |
| 1.410.000 | Merrill Lynch International | 2,23 % | 22.08.2019 | 1.410.000 |
| 962.000 | Merrill Lynch International | 1,74 % | 24.12.2019 | 962.000 |
| 924.000 | Merrill Lynch International | 1,94 % | 23.10.2019 | 924.000 |
| 911.000 | Barclays Bank Plc | 2,34 % | 23.07.2019 | 911.000 |
| 906.000 | Barclays Bank Plc | 2,24 % | 22.08.2019 | 906.000 |

L&G Gold Mining UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten US\$ |
|-------------|-----------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 238.561.799 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 238.561.799 |
| 235.033.135 | Merrill Lynch International | 1,82 % | 22.11.2019 | 235.033.135 |
| 229.256.799 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 229.256.799 |
| 225.453.135 | Merrill Lynch International | 1,82 % | 22.11.2019 | 225.453.135 |
| 223.828.135 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 223.828.135 |
| 221.141.799 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 221.141.799 |
| 219.752.135 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 219.752.135 |
| 215.171.799 | Merrill Lynch International | 1,78 % | 23.01.2020 | 215.171.799 |
| 212.668.135 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 212.668.135 |
| 210.121.799 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 210.121.799 |
| 209.362.135 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 209.362.135 |
| 202.188.135 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 202.188.135 |
| 198.879.135 | Merrill Lynch International | 2,27 % | 22.08.2019 | 198.879.135 |
| 189.169.135 | Merrill Lynch International | 2,27 % | 22.08.2019 | 189.169.135 |
| 19.598.000 | Merrill Lynch International | 1,94 % | 23.10.2019 | 19.598.000 |
| 16.665.000 | Merrill Lynch International | 2,27 % | 22.08.2019 | 16.665.000 |
| 7.950.000 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 7.950.000 |
| 6.516.000 | Merrill Lynch International | 2,04 % | 24.09.2019 | 6.516.000 |
| 5.810.000 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 5.810.000 |
| 5.370.000 | Merrill Lynch International | 2,27 % | 22.08.2019 | 5.370.000 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse US\$ |
|-------------|-----------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 238.561.799 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 238.561.799 |
| 235.033.135 | Merrill Lynch International | 1,82 % | 22.11.2019 | 235.033.135 |
| 229.256.799 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 229.256.799 |
| 225.453.135 | Merrill Lynch International | 1,82 % | 22.11.2019 | 225.453.135 |
| 223.828.135 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 223.828.135 |
| 221.141.799 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 221.141.799 |
| 219.752.135 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 219.752.135 |
| 212.668.135 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 212.668.135 |
| 210.121.799 | Merrill Lynch International | 1,71 % | 24.12.2019 | 210.121.799 |
| 209.362.135 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 209.362.135 |
| 202.188.135 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 202.188.135 |
| 198.879.135 | Merrill Lynch International | 2,27 % | 22.08.2019 | 198.879.135 |
| 195.643.135 | Merrill Lynch International | 2,40 % | 23.07.2019 | 195.643.135 |
| 189.169.135 | Merrill Lynch International | 2,27 % | 22.08.2019 | 189.169.135 |
| 19.598.000 | Merrill Lynch International | 1,94 % | 23.10.2019 | 19.598.000 |
| 16.665.000 | Merrill Lynch International | 2,27 % | 22.08.2019 | 16.665.000 |
| 7.950.000 | Merrill Lynch International | 2,17 % | 24.09.2019 | 7.950.000 |
| 6.516.000 | Merrill Lynch International | 2,04 % | 24.09.2019 | 6.516.000 |
| 5.810.000 | Merrill Lynch International | 2,02 % | 23.10.2019 | 5.810.000 |
| 5.370.000 | Merrill Lynch International | 2,27 % | 22.08.2019 | 5.370.000 |

L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten US\$ |
|------------|----------------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 32.564.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 32.564.700 |
| 29.464.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 29.464.700 |
| 28.234.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 28.234.700 |
| 26.959.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 26.959.700 |
| 24.209.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 24.209.700 |
| 23.064.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,17 % | 24.09.2019 | 23.064.700 |
| 20.664.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,02 % | 23.10.2019 | 20.664.700 |
| 19.834.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,02 % | 23.10.2019 | 19.834.700 |
| 18.964.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,02 % | 23.10.2019 | 18.964.700 |
| 18.869.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,17 % | 24.09.2019 | 18.869.700 |
| 17.699.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,02 % | 23.10.2019 | 17.699.700 |
| 17.699.700 | Citigroup Global Markets Limited | 1,82 % | 22.11.2019 | 17.699.700 |
| 17.009.700 | Citigroup Global Markets Limited | 1,82 % | 22.11.2019 | 17.009.700 |
| 15.904.700 | Citigroup Global Markets Limited | 1,78 % | 23.01.2020 | 15.904.700 |
| 15.009.700 | Citigroup Global Markets Limited | 1,71 % | 24.12.2019 | 15.009.700 |
| 14.274.700 | Citigroup Global Markets Limited | 1,71 % | 24.12.2019 | 14.274.700 |
| 2.712.000 | Citigroup Global Markets Limited | 2,37 % | 23.07.2019 | 2.712.000 |
| 1.795.000 | Citigroup Global Markets Limited | 2,17 % | 24.09.2019 | 1.795.000 |
| 1.630.000 | Citigroup Global Markets Limited | 1,71 % | 24.12.2019 | 1.630.000 |
| 1.101.000 | Citigroup Global Markets Limited | 2,40 % | 23.07.2019 | 1.101.000 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse US\$ |
|------------|----------------------------------|----------|--------------------|-------------|
| 32.564.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 32.564.700 |
| 29.464.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 29.464.700 |
| 28.234.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 28.234.700 |
| 26.959.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 26.959.700 |
| 24.830.485 | Citigroup Global Markets Limited | 2,40 % | 23.07.2019 | 24.830.485 |
| 24.209.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,27 % | 22.08.2019 | 24.209.700 |
| 23.064.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,17 % | 24.09.2019 | 23.064.700 |
| 20.664.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,02 % | 23.10.2019 | 20.664.700 |
| 19.834.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,02 % | 23.10.2019 | 19.834.700 |
| 18.964.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,02 % | 23.10.2019 | 18.964.700 |
| 18.869.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,17 % | 24.09.2019 | 18.869.700 |
| 17.699.700 | Citigroup Global Markets Limited | 2,02 % | 23.10.2019 | 17.699.700 |
| 17.699.700 | Citigroup Global Markets Limited | 1,82 % | 22.11.2019 | 17.699.700 |
| 17.009.700 | Citigroup Global Markets Limited | 1,82 % | 22.11.2019 | 17.009.700 |
| 15.009.700 | Citigroup Global Markets Limited | 1,71 % | 24.12.2019 | 15.009.700 |
| 14.274.700 | Citigroup Global Markets Limited | 1,71 % | 24.12.2019 | 14.274.700 |
| 2.712.000 | Citigroup Global Markets Limited | 2,37 % | 23.07.2019 | 2.712.000 |
| 1.795.000 | Citigroup Global Markets Limited | 2,17 % | 24.09.2019 | 1.795.000 |
| 1.630.000 | Citigroup Global Markets Limited | 1,71 % | 24.12.2019 | 1.630.000 |
| 1.101.000 | Citigroup Global Markets Limited | 2,40 % | 23.07.2019 | 1.101.000 |

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--------------------------------------|----------------|
| 564.114 | Vocera Communications Inc | 14.035.976 |
| 187.373 | iRobot Corp | 10.159.012 |
| 33.271 | ServiceNow Inc | 9.039.074 |
| 617.478 | Blue Prism Group plc | 8.181.215 |
| 325.887 | Hollysys Automation Technologies Ltd | 5.316.909 |
| 66.336 | Krones AG | 4.226.719 |
| 774.600 | Iflytek Co Ltd 'A' | 3.689.019 |
| 18.643 | Kardex AG | 2.682.547 |
| 126.462 | Stratasys Ltd | 2.646.823 |
| 40.023 | AeroVironment Inc | 2.465.180 |
| 72.500 | Nabtesco Corp | 2.223.808 |
| 77.653 | Duerr AG | 2.115.993 |
| 30.327 | PTC Inc | 2.051.235 |
| 33.994 | Ambarella Inc | 1.972.709 |
| 49.715 | Brooks Automation Inc | 1.941.799 |
| 19.654 | Xilinx Inc | 1.929.922 |
| 100.916 | Materialise NV ADR | 1.912.011 |
| 210.000 | Hiwin Technologies Corp | 1.889.357 |
| 49.800 | Yaskawa Electric Corp | 1.862.369 |
| 6.032 | Illumina Inc | 1.857.317 |
| 38.200 | Harmonic Drive Systems Inc | 1.752.624 |
| 66.234 | Jenoptik AG | 1.746.183 |
| 40.715 | BioTelemetry Inc | 1.709.643 |
| 28.600 | Daifuku Co Ltd | 1.482.776 |
| 28.138 | FLIR Systems Inc | 1.469.635 |
| 12.303 | Varian Medical Systems Inc | 1.440.909 |
| 9.510 | IPG Photonics Corp | 1.345.643 |
| 17.423 | Koh Young Technology Inc | 1.304.523 |
| 99.396 | Elektro AB | 1.294.908 |
| 71.100 | Yokogawa Electric Corp | 1.291.814 |

L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|-------------------------------|----------------|
| 846.327 | Oceaneering International Inc | 12.363.482 |
| 134.232 | FARO Technologies Inc | 6.736.162 |
| 106.694 | Ambarella Inc | 6.554.817 |
| 30.715 | NVIDIA Corp | 5.599.719 |
| 325.950 | Fuji Corp/Aichi | 5.134.986 |
| 555.301 | Hiwin Technologies Corp | 4.794.230 |
| 365.452 | Airtac International Group | 4.793.917 |
| 131.900 | Yaskawa Electric Corp | 4.727.729 |
| 20.170 | Zebra Technologies Corp | 4.488.608 |
| 101.700 | Harmonic Drive Systems Inc | 4.285.373 |
| 136.500 | Nabtesco Corp | 4.181.198 |
| 69.830 | Teradyne Inc | 4.151.156 |
| 75.962 | Globus Medical Inc | 3.976.826 |
| 11.936 | Teledyne Technologies Inc | 3.804.243 |
| 8.500 | SMC Corp/Japan | 3.575.686 |
| 42.399 | Manhattan Associates Inc | 3.507.548 |
| 194.784 | Materialise NV ADR | 3.495.181 |
| 19.119 | Rockwell Automation Inc | 3.440.067 |
| 61.100 | Daifuku Co Ltd | 3.405.628 |
| 52.206 | KION Group AG | 3.356.987 |
| 6.500 | Keyence Corp | 3.228.530 |
| 36.246 | Aptiv Plc | 3.160.058 |
| 117.100 | THK Co Ltd | 3.031.839 |
| 59.728 | Cognex Corp | 2.894.982 |
| 53.200 | Omron Corp | 2.888.127 |
| 18.603 | Nordson Corp | 2.836.577 |
| 171.742 | Ocado Group Plc | 2.787.740 |
| 40.499 | Krones AG | 2.699.017 |
| 50.649 | Hexagon AB | 2.691.196 |
| 20.055 | Varian Medical Systems Inc | 2.657.182 |
| 21.503 | Siemens AG | 2.626.814 |
| 33.453 | QUALCOMM Inc | 2.581.978 |
| 300.000 | Global Unichip Corp | 2.444.578 |
| 15.693 | Kardex AG | 2.402.654 |
| 25.709 | Schneider Electric SE | 2.395.475 |
| 54.732 | Isra Vision AG | 2.346.158 |
| 78.200 | Amano Corp | 2.343.172 |
| 4.244 | Intuitive Surgical Inc | 2.303.250 |
| 74.833 | Daihen Corp | 2.297.612 |

L&G Cyber Security UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|----------------|
| 870.074 | SailPoint Technologies Holding Inc | 18.090.356 |
| 944.600 | SolarWinds Corp | 17.761.132 |
| 95.593 | General Dynamics Corp | 17.537.064 |
| 200.763 | Science Applications International Corp | 17.177.306 |
| 89.955 | Raytheon Co | 16.148.204 |
| 303.828 | Rapid7 Inc | 15.950.926 |
| 138.620 | CyberArk Software Ltd | 15.771.845 |
| 866.252 | FireEye Inc | 13.740.334 |
| 161.934 | Qualys Inc | 13.522.931 |
| 352.575 | Parsons Corp | 13.310.969 |
| 164.902 | Atos SE | 13.209.566 |
| 92.817 | Splunk Inc | 12.043.869 |
| 495.552 | NetScout Systems Inc | 11.824.016 |
| 127.132 | Fortinet Inc | 11.731.837 |
| 97.853 | Check Point Software Technologies Ltd | 11.018.992 |
| 447.761 | Juniper Networks Inc | 11.004.944 |
| 234.249 | Cisco Systems Inc | 10.900.743 |
| 47.585 | Palo Alto Networks Inc | 10.631.820 |
| 404.298 | Radware Ltd | 9.605.868 |
| 179.273 | Trend Micro Inc/Japan | 9.103.185 |
| 1.311.159 | Sophos Group PLC '144A' | 8.325.148 |
| 790.109 | Mitek Systems Inc | 7.932.196 |
| 65.339 | Proofpoint Inc | 7.883.025 |
| 266.767 | Tenable Holdings Inc | 7.416.817 |
| 213.174 | ForeScout Technologies Inc | 7.299.914 |
| 139.805 | Verint Systems Inc | 7.281.102 |
| 125.617 | Zscaler Inc | 7.168.960 |
| 79.538 | Akamai Technologies Inc | 6.957.028 |
| 47.863 | F5 Networks Inc | 6.898.372 |
| 1.450.639 | Avast Plc '144A' | 6.756.072 |
| 151.043 | Mimecast Ltd | 6.744.480 |
| 945.437 | BAE Systems Plc | 6.437.884 |
| 362.626 | Tufin Software Technologies Ltd | 6.338.693 |
| 92.401 | Varonis Systems Inc | 6.337.389 |
| 856.784 | A10 Networks Inc | 6.197.223 |
| 364.170 | OneSpan Inc | 5.586.692 |
| 47.074 | Thales SA | 5.223.755 |
| 2.772.667 | Fingerprint Cards AB - Class B | 5.038.555 |
| 22.759 | CACI International Inc - Class A | 5.038.023 |
| 386.078 | SecureWorks Corp | 4.934.796 |
| 68.315 | Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A | 4.774.109 |

L&G Cyber Security UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|--|----------------|
| 8.499.747 | Sophos Group PLC '144A' | 57.426.977 |
| 774.336 | FFRI Inc | 24.481.511 |
| 913.543 | Carbon Black Inc | 23.677.070 |
| 1.578.665 | SecureWorks Corp | 19.596.971 |
| 89.955 | Raytheon Co | 17.864.812 |
| 297.829 | Ahnlab Inc | 14.862.617 |
| 8.932.036 | Fingerprint Cards AB - Class B | 14.513.537 |
| 66.693 | VeriSign Inc | 12.586.335 |
| 167.150 | Rapid7 Inc | 10.437.379 |
| 110.532 | Akamai Technologies Inc | 9.228.475 |
| 60.166 | CyberArk Software Ltd | 8.308.004 |
| 1.371.151 | Avast Plc '144A' | 7.572.568 |
| 81.043 | Qualys Inc | 7.097.552 |
| 385.436 | OneSpan Inc | 6.576.943 |
| 46.086 | Splunk Inc | 6.364.409 |
| 108.389 | Cisco Systems Inc | 6.113.736 |
| 214.264 | Juniper Networks Inc | 5.732.091 |
| 2.279.462 | NCC Group Plc | 5.681.771 |
| 43.436 | Proofpoint Inc | 5.339.686 |
| 21.369 | CACI International Inc - Class A | 4.949.082 |
| 660.003 | BAE Systems Plc | 4.860.220 |
| 60.282 | ManTech International Corp/VA - Class A | 4.546.275 |
| 48.691 | Leidos Holdings Inc | 4.280.726 |
| 58.248 | Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A | 4.199.033 |
| 175.261 | Symantec Corp | 3.918.361 |
| 148.872 | Radware Ltd | 3.657.027 |
| 40.095 | Fortinet Inc | 3.543.276 |

L&G All Commodities UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten US\$ |
|------------|-------------------|----------|--------------------|-------------|
| 52.900.070 | Barclays Bank Plc | 1,81 % | 23.01.2020 | 52.900.070 |
| 51.309.658 | Barclays Bank Plc | 2,07 % | 23.10.2019 | 51.309.658 |
| 50.909.000 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 50.909.000 |
| 50.073.658 | Barclays Bank Plc | 1,86 % | 22.11.2019 | 50.073.658 |
| 50.073.658 | Barclays Bank Plc | 1,75 % | 24.12.2019 | 50.073.658 |
| 49.169.658 | Barclays Bank Plc | 2,07 % | 23.10.2019 | 49.169.658 |
| 47.984.000 | Barclays Bank Plc | 2,17 % | 24.09.2019 | 47.984.000 |
| 1.720.000 | Barclays Bank Plc | 2,21 % | 24.09.2019 | 1.720.000 |
| 1.265.000 | Barclays Bank Plc | 2,40 % | 23.07.2019 | 1.265.000 |
| 931.412 | Barclays Bank Plc | 1,75 % | 24.12.2019 | 931.412 |
| 931.000 | Barclays Bank Plc | 2,35 % | 23.07.2019 | 931.000 |
| 904.000 | Barclays Bank Plc | 1,96 % | 23.10.2019 | 904.000 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse US\$ |
|------------|-------------------|----------|--------------------|-------------|
| 51.309.658 | Barclays Bank Plc | 2,07 % | 23.10.2019 | 51.309.658 |
| 50.909.000 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 50.909.000 |
| 50.073.658 | Barclays Bank Plc | 1,86 % | 22.11.2019 | 50.073.658 |
| 50.073.658 | Barclays Bank Plc | 1,75 % | 24.12.2019 | 50.073.658 |
| 49.169.658 | Barclays Bank Plc | 2,07 % | 23.10.2019 | 49.169.658 |
| 47.984.000 | Barclays Bank Plc | 2,17 % | 24.09.2019 | 47.984.000 |
| 47.791.000 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 47.791.000 |
| 1.720.000 | Barclays Bank Plc | 2,21 % | 24.09.2019 | 1.720.000 |
| 1.265.000 | Barclays Bank Plc | 2,40 % | 23.07.2019 | 1.265.000 |
| 931.412 | Barclays Bank Plc | 1,75 % | 24.12.2019 | 931.412 |
| 931.000 | Barclays Bank Plc | 2,35 % | 23.07.2019 | 931.000 |
| 922.000 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 922.000 |
| 904.000 | Barclays Bank Plc | 1,96 % | 23.10.2019 | 904.000 |

Vorstehend aufgeführt sind alle Käufe und Verkäufe des Fonds im Berichtszeitraum.

L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Kosten US\$ |
|-----------|-------------------|----------|--------------------|-------------|
| 8.454.553 | Barclays Bank Plc | 2,08 % | 23.10.2019 | 8.454.553 |
| 8.454.553 | Barclays Bank Plc | 1,86 % | 22.11.2019 | 8.454.553 |
| 8.454.553 | Barclays Bank Plc | 1,76 % | 24.12.2019 | 8.454.553 |
| 8.454.553 | Barclays Bank Plc | 1,82 % | 23.01.2020 | 8.454.553 |
| 8.233.000 | Barclays Bank Plc | 2,21 % | 24.09.2019 | 8.233.000 |
| 7.893.000 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 7.893.000 |
| 340.000 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 340.000 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Zinssatz | Fälligkeits-termin | Erlöse US\$ |
|-----------|-------------------|----------|--------------------|-------------|
| 8.454.553 | Barclays Bank Plc | 2,08 % | 23.10.2019 | 8.454.553 |
| 8.454.553 | Barclays Bank Plc | 1,86 % | 22.11.2019 | 8.454.553 |
| 8.454.553 | Barclays Bank Plc | 1,76 % | 24.12.2019 | 8.454.553 |
| 8.233.000 | Barclays Bank Plc | 2,21 % | 24.09.2019 | 8.233.000 |
| 7.893.000 | Barclays Bank Plc | 2,44 % | 23.07.2019 | 7.893.000 |
| 7.893.000 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 7.893.000 |
| 340.000 | Barclays Bank Plc | 2,30 % | 22.08.2019 | 340.000 |

Vorstehend aufgeführt sind alle Käufe und Verkäufe des Fonds im Berichtszeitraum.

L&G Battery Value-Chain UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|---|----------------|
| 35.475 | DMG Mori AG | 1.672.537 |
| 2.217.403 | Galaxy Resources Ltd | 1.575.202 |
| 25.554 | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR | 648.986 |
| 346.828 | Orocobre Ltd | 635.740 |
| 124.288 | BYD Co Ltd 'H' | 604.828 |
| 91.100 | Nissan Motor Co Ltd | 571.710 |
| 6.703 | Albemarle Corp | 440.767 |
| 12.300 | Hitachi Chemical Co Ltd | 424.353 |
| 1.544 | LG Chem Ltd | 410.381 |
| 1.310 | Tesla Inc | 404.634 |
| 2.977 | SK Innovation Co Ltd | 404.193 |
| 12.043 | Toshiba Corp | 404.181 |
| 6.500 | Sony Corp | 403.629 |
| 3.900 | TDK Corp | 394.175 |
| 9.400 | NEC Corp | 386.722 |
| 13.845 | Evonik Industries AG | 381.488 |
| 4.070 | FMC Corp | 375.693 |
| 17.348 | ABB Ltd | 367.351 |
| 19.000 | GS Yuasa Corp | 366.598 |
| 25.800 | Sumitomo Electric Industries Ltd | 359.604 |
| 22.500 | NGK Insulators Ltd | 354.808 |
| 5.146 | EnerSys | 351.173 |
| 39.600 | Panasonic Corp | 345.636 |
| 1.768 | Samsung SDI Co Ltd | 344.986 |
| 24.600 | Mitsubishi Electric Corp | 343.961 |
| 2.400 | Nidec Corp | 342.599 |
| 7.000 | Sanyo Chemical Industries Ltd | 335.704 |
| 4.364 | Bayerische Motoren Werke AG | 335.506 |
| 2.830 | Siemens AG | 334.819 |
| 32.704 | General Electric Co | 330.987 |
| 285.200 | Dongfang Electric Corp Ltd | 162.682 |

L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|-----------|---|----------------|
| 2.610.316 | Dongfang Electric Corp Ltd | 1.411.730 |
| 3.171 | Tesla Inc | 953.395 |
| 11.800 | Sony Corp | 703.176 |
| 7.534 | FMC Corp | 684.963 |
| 7.300 | TDK Corp | 682.559 |
| 20.400 | Hitachi Chemical Co Ltd | 633.633 |
| 14.300 | NEC Corp | 595.429 |
| 37.100 | NGK Insulators Ltd | 566.078 |
| 39.900 | Sumitomo Electric Industries Ltd | 531.093 |
| 25.460 | ABB Ltd | 511.880 |
| 48.970 | General Electric Co | 486.523 |
| 56.700 | Panasonic Corp | 484.859 |
| 25.800 | GS Yuasa Corp | 481.308 |
| 3.300 | Nidec Corp | 453.387 |
| 2.309 | Samsung SDI Co Ltd | 450.736 |
| 30.800 | Mitsubishi Electric Corp | 412.823 |
| 6.124 | EnerSys | 401.445 |
| 5.266 | Bayerische Motoren Werke AG | 379.771 |
| 11.538 | Toshiba Corp | 359.246 |
| 3.092 | Siemens AG | 333.317 |
| 7.100 | Sanyo Chemical Industries Ltd | 328.161 |
| 2.325 | SK Innovation Co Ltd | 320.098 |
| 4.637 | Albemarle Corp | 311.268 |
| 1.151 | LG Chem Ltd | 304.112 |
| 11.411 | Evonik Industries AG | 290.314 |
| 43.100 | Nissan Motor Co Ltd | 284.093 |
| 53.500 | BYD Co Ltd 'H' | 281.493 |
| 9.624 | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR | 264.394 |
| 136.367 | Orocobre Ltd | 240.159 |

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|-------------------------------|----------------|
| 131.832 | Mallinckrodt Plc | 436.412 |
| 15.727 | Santen Pharmaceutical Co Ltd | 275.284 |
| 16.727 | Halozyme Therapeutics Inc | 274.100 |
| 7.316 | H Lundbeck A/S | 257.090 |
| 904 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 256.225 |
| 10.853 | Retrophin Inc | 142.012 |
| 1.254 | United Therapeutics Corp | 103.418 |
| 404 | Biogen Inc | 98.023 |
| 995 | Ligand Pharmaceuticals Inc | 97.734 |
| 2.024 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | 95.194 |
| 841 | Ipsen SA | 87.378 |
| 644 | Alexion Pharmaceuticals Inc | 70.570 |
| 475 | BeiGene Ltd ADR | 69.966 |
| 924 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 69.869 |
| 3.853 | Swedish Orphan Biovitrum AB | 68.003 |
| 1.066 | PTC Therapeutics Inc | 48.754 |
| 1.279 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | 46.842 |
| 1.337 | Grifols SA | 43.458 |
| 264 | CSL Ltd | 42.607 |
| 516 | Nippon Shinyaku Co Ltd | 41.396 |
| 293 | Jazz Pharmaceuticals Plc | 40.912 |
| 203 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 38.475 |
| 587 | Ionis Pharmaceuticals Inc | 38.175 |
| 1.386 | Horizon Therapeutics Plc | 37.471 |
| 406 | Novartis AG | 37.029 |
| 430 | Incyte Corp | 36.677 |
| 344 | Celgene Corp | 32.207 |
| 17.336 | Pharma Mar SA | 30.964 |

L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|-------------------------------|----------------|
| 11.209 | Array BioPharma Inc | 538.032 |
| 170.947 | Pharma Mar SA | 362.192 |
| 3.386 | Celgene Corp | 358.960 |
| 5.844 | Basilea Pharmaceutica AG | 272.670 |
| 25.436 | BTG Plc | 259.397 |
| 27.770 | Spectrum Pharmaceuticals Inc | 246.025 |
| 3.500 | Eisai Co Ltd | 178.772 |
| 14.387 | Bukwang Pharmaceutical Co Ltd | 169.315 |
| 4.301 | Agios Pharmaceuticals Inc | 162.308 |
| 1.329 | Nippon Shinyaku Co Ltd | 106.627 |
| 2.193 | PTC Therapeutics Inc | 93.992 |
| 556 | CSL Ltd | 88.312 |
| 2.519 | Grifols SA | 75.661 |
| 637 | Alcon Inc | 38.080 |
| 342 | Novartis AG | 30.010 |
| 924 | Horizon Therapeutics Plc | 24.561 |
| 109 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 19.287 |
| 317 | Emergent BioSolutions Inc | 16.483 |
| 88 | Jazz Pharmaceuticals Plc | 11.620 |
| 56 | Ligand Pharmaceuticals Inc | 5.704 |

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|-----------|--|----------------|
| 8.492 | Mainfreight Ltd | 220.176 |
| 1.100.878 | Li & Fung Ltd | 122.233 |
| 705 | FedEx Corp | 108.047 |
| 338.000 | Sinotrans Ltd 'H' | 106.657 |
| 1.969 | Ryder System Inc | 103.169 |
| 741 | CJ Logistics Corp | 97.457 |
| 10.200 | Japan Post Holdings Co Ltd | 94.376 |
| 4.334 | Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA | 92.202 |
| 911 | DSV PANALPINA A/S | 90.534 |
| 20.957 | Bolllore SA | 88.478 |
| 7.794 | Vipshop Holdings Ltd ADR | 86.184 |
| 450 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | 81.249 |
| 7.010 | bpost SA | 79.879 |
| 5.000 | Kintetsu World Express Inc | 79.215 |
| 1.400 | Nippon Express Co Ltd | 79.005 |
| 2.169 | Deutsche Post AG | 76.877 |
| 43 | Amazon.com Inc | 75.789 |
| 968 | XPO Logistics Inc | 75.450 |
| 4.624 | Ocado Group Plc | 75.003 |
| 9.100 | Senko Group Holdings Co Ltd | 74.201 |
| 997 | Expeditors International of Washington Inc | 73.911 |
| 461 | Kuehne + Nagel International AG | 73.867 |
| 616 | SYNNEX Corp | 73.728 |
| 2.350 | JD.com Inc ADR | 73.669 |
| 4.100 | Nippon Yusen KK | 72.978 |
| 1.800 | Descartes Systems Group Inc/The | 72.662 |
| 558 | SAP SE | 72.095 |
| 597 | Walmart Inc | 70.869 |
| 7.700 | Rakuten Inc | 70.823 |
| 883 | Manhattan Associates Inc | 70.812 |
| 597 | United Parcel Service Inc - Class B | 69.767 |
| 1.529 | Zalando SE '144A' | 69.182 |
| 1.228 | Oracle Corp | 67.663 |
| 2.300 | Hitachi Transport System Ltd | 66.932 |

L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|-------------------------------------|----------------|
| 1.969 | DSV PANALPINA A/S | 188.359 |
| 968 | Manhattan Associates Inc | 75.847 |
| 265 | Walmart Inc | 31.570 |
| 405 | XPO Logistics Inc | 31.078 |
| 192 | SAP SE | 24.770 |
| 1.100 | Nippon Yusen KK | 19.553 |
| 1.688 | Vipshop Holdings Ltd ADR | 15.917 |
| 400 | Descartes Systems Group Inc/The | 15.710 |
| 332 | Zalando SE '144A' | 15.358 |
| 89 | Kuehne + Nagel International AG | 13.224 |
| 112 | SYNNEX Corp | 13.072 |
| 350 | Hitachi Transport System Ltd | 10.288 |
| 180 | Oracle Corp | 9.818 |
| 46 | United Parcel Service Inc - Class B | 5.398 |

Vorstehend aufgeführt sind alle Verkäufe des Fonds im Berichtszeitraum.

L&G US Equity UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|----------------|
| 4.968 | Microsoft Corp | 723.102 |
| 297 | Amazon.com Inc | 542.241 |
| 1.917 | Apple Inc | 482.681 |
| 2.947 | Fidelity National Information Services Inc | 389.513 |
| 1.670 | Facebook Inc - Class A | 326.303 |
| 252 | Alphabet Inc | 308.842 |
| 1.942 | JPMorgan Chase & Co | 240.004 |
| 973 | Berkshire Hathaway Inc - Class B | 210.552 |
| 1.118 | Visa Inc - Class A | 203.465 |
| 1.682 | Procter & Gamble Co/The | 201.701 |
| 5.477 | AT&T Inc | 199.311 |
| 2.737 | Exxon Mobil Corp | 193.584 |
| 1.206 | salesforce.com Inc | 189.489 |
| 3.433 | Blackstone Group Inc/The | 178.662 |
| 3.033 | Verizon Communications Inc | 178.260 |
| 137 | Alphabet Inc - Class A | 177.986 |
| 3.842 | Dow Inc | 174.301 |
| 626 | UnitedHealth Group Inc | 163.487 |
| 567 | Mastercard Inc | 161.899 |
| 701 | Home Depot Inc/The | 155.039 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--|----------------|
| 20.219 | Wells Fargo & Co | 1.087.705 |
| 3.451 | Celgene Corp | 373.282 |
| 1.447 | Worldpay Inc - Class A | 197.025 |
| 2.459 | Anadarko Petroleum Corp | 179.003 |
| 1.105 | Fidelity National Information Services Inc | 148.590 |
| 773 | Red Hat Inc | 146.870 |
| 2.599 | CBRE Group Inc - Class A | 134.255 |
| 2.518 | Alliant Energy Corp | 127.628 |
| 584 | Apple Inc | 127.579 |
| 1.672 | Lennar Corp | 99.009 |
| 774 | Extra Space Storage Inc (REIT) | 90.536 |
| 777 | Pinnacle West Capital Corp | 72.264 |
| 1.899 | Fox Corp | 70.334 |
| 1.704 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM | 69.995 |
| 733 | Keysight Technologies Inc | 62.469 |
| 786 | Copart Inc | 58.985 |
| 362 | Veeva Systems Inc - Class A | 57.862 |
| 542 | Fiserv Inc | 56.933 |
| 1.162 | SS&C Technologies Holdings Inc | 51.368 |
| 1.156 | Newmont Goldcorp Corp | 43.520 |

L&G UK Equity UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Kosten £ |
|---------|---------------------------------|-------------|
| 9.278 | Royal Dutch Shell Plc | 217.000 |
| 2.251 | Royal Dutch Shell Plc | 51.217 |
| 2.400 | BHP Group Plc | 45.598 |
| 601 | DCC Plc | 41.113 |
| 430 | Spirax-Sarco Engineering Plc | 36.151 |
| 1.595 | GlaxoSmithKline Plc | 26.497 |
| 5.120 | Investec Plc | 21.706 |
| 438 | Coca-Cola European Partners Plc | 20.151 |
| 954 | Liberty Global Plc | 19.145 |
| 415 | AVEVA Group Plc | 17.560 |
| 490 | Diageo Plc | 15.923 |
| 541 | British American Tobacco Plc | 15.832 |
| 2.538 | HSBC Holdings Plc | 15.709 |
| 322 | Whitbread Plc | 14.739 |
| 634 | Mondi Plc | 11.063 |
| 850 | National Grid Plc | 7.534 |
| 102 | AstraZeneca Plc | 7.347 |
| 344 | Hikma Pharmaceuticals Plc | 7.158 |
| 466 | Prudential Plc | 7.065 |
| 796 | Rolls-Royce Holdings Plc | 6.291 |

L&G UK Equity UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse £ |
|---------|--|-------------|
| 1.712 | Royal Dutch Shell Plc | 40.041 |
| 2.001 | BHP Group Plc | 35.200 |
| 508 | DCC Plc | 34.202 |
| 412 | Ferguson Plc | 24.417 |
| 477 | Coca-Cola European Partners Plc | 21.553 |
| 279 | AstraZeneca Plc | 19.868 |
| 906 | Liberty Global Plc | 16.663 |
| 3.626 | Merlin Entertainments Plc | 16.486 |
| 736 | Liberty Global Plc | 16.213 |
| 932 | GlaxoSmithKline Plc | 15.451 |
| 3.288 | Investec Plc | 14.939 |
| 717 | Admiral Group Plc | 14.847 |
| 2.666 | RSA Insurance Group Plc | 14.379 |
| 4.568 | Direct Line Insurance Group Plc | 14.017 |
| 355 | Diageo Plc | 11.994 |
| 2.257 | BP Plc | 11.410 |
| 1.689 | HSBC Holdings Plc | 10.596 |
| 1.340 | Subsea 7 SA | 10.320 |
| 388 | Royal Dutch Shell Plc | 10.036 |
| 199 | Whitbread Plc | 9.894 |
| 1.027 | Farfetch Ltd | 9.689 |
| 291 | British American Tobacco Plc | 8.747 |
| 1.121 | International Consolidated Airlines Group SA | 8.053 |
| 719 | National Grid Plc | 6.062 |
| 140 | Rio Tinto Plc | 5.873 |
| 523 | SSE Plc | 5.666 |
| 440 | Ocado Group Plc | 5.095 |
| 2.708 | Wm Morrison Supermarkets Plc | 5.000 |
| 85 | Next Plc | 4.996 |
| 659 | Rolls-Royce Holdings Plc | 4.810 |

L&G Japan Equity UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|-------------------------------------|----------------|
| 10.300 | Toyota Motor Corp | 688.504 |
| 7.800 | SoftBank Group Corp | 350.911 |
| 5.900 | Sony Corp | 339.043 |
| 500 | Keyence Corp | 312.623 |
| 8.100 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | 300.175 |
| 55.200 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | 277.709 |
| 10.200 | Honda Motor Co Ltd | 268.855 |
| 6.900 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 243.524 |
| 7.200 | Recruit Holdings Co Ltd | 242.970 |
| 4.900 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | 236.068 |
| 1.200 | FANUC Corp | 221.755 |
| 3.400 | Daiichi Sankyo Co Ltd | 207.424 |
| 2.500 | Hoya Corp | 203.601 |
| 500 | Nintendo Co Ltd | 190.084 |
| 126.800 | Mizuho Financial Group Inc | 189.320 |
| 300 | Fast Retailing Co Ltd | 186.188 |
| 1.400 | Daikin Industries Ltd | 186.025 |
| 900 | Central Japan Railway Co | 183.316 |
| 1.300 | Nidec Corp | 179.485 |
| 6.500 | KDDI Corp | 176.030 |

L&G Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--|----------------|
| 3.400 | Toyota Motor Corp | 226.800 |
| 4.100 | SoftBank Group Corp | 188.099 |
| 1.300 | Oriental Land Co Ltd/Japan | 187.008 |
| 3.800 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | 184.143 |
| 48.500 | Z Holdings Corp | 162.363 |
| 700 | FANUC Corp | 125.347 |
| 8.700 | Chugoku Electric Power Co Inc/The | 115.659 |
| 1.800 | Sony Corp | 113.649 |
| 20.700 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | 105.475 |
| 47 | Japan Retail Fund Investment Corp (REIT) | 103.233 |
| 500 | Central Japan Railway Co | 99.883 |
| 200 | Keyence Corp | 96.575 |
| 2.400 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd | 87.731 |
| 200 | SMC Corp/Japan | 87.122 |
| 5.200 | Sumitomo Corp | 79.797 |
| 3.300 | ZOZO Inc | 79.672 |
| 3.000 | Honda Motor Co Ltd | 79.131 |
| 200 | Nintendo Co Ltd | 79.085 |
| 2.300 | Recruit Holdings Co Ltd | 75.548 |
| 700 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 75.114 |
| 5.400 | Softbank Corp | 74.873 |
| 1.900 | Hitachi Ltd | 74.856 |
| 2.800 | NTT DOCOMO Inc | 74.450 |
| 800 | Hoya Corp | 70.931 |
| 1.000 | Daiichi Sankyo Co Ltd | 66.351 |
| 1.900 | Unicharm Corp | 64.401 |
| 800 | Shiseido Co Ltd | 61.676 |
| 100 | Fast Retailing Co Ltd | 60.355 |
| 1.700 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 56.124 |

L&G Global Equity UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|----------------|
| 650 | Groupe Bruxelles Lambert SA | 68.141 |
| 35 | Amazon.com Inc | 61.925 |
| 395 | Microsoft Corp | 61.437 |
| 532 | Medtronic Plc | 60.938 |
| 384 | United Technologies Corp | 57.396 |
| 8.716 | BP Plc | 54.671 |
| 605 | Bayerische Motoren Werke AG | 51.139 |
| 1.900 | Mitsubishi Corp | 50.678 |
| 700 | Toyota Motor Corp | 49.711 |
| 351 | Siemens AG | 46.875 |
| 1.048 | Comcast Corp | 45.622 |
| 100 | Fairfax Financial Holdings Ltd | 45.072 |
| 1.566 | Royal Dutch Shell Plc | 44.578 |
| 220 | Facebook Inc - Class A | 43.545 |
| 150 | Roche Holding AG | 40.536 |
| 530 | CVS Health Corp | 39.434 |
| 119 | Broadcom Inc | 38.454 |
| 28 | Alphabet Inc - Class A | 38.102 |
| 708 | Mondelez International Inc | 38.029 |
| 800 | Dow Inc | 35.914 |
| 148 | NextEra Energy Inc | 35.443 |
| 571 | Verizon Communications Inc | 34.964 |
| 560 | Alcon Inc | 33.063 |
| 146 | NVIDIA Corp | 32.874 |
| 465 | Prosus NV | 32.448 |
| 320 | AstraZeneca Plc | 31.712 |
| 281 | PayPal Holdings Inc | 30.791 |
| 227 | Fidelity National Information Services Inc | 30.349 |
| 216 | PepsiCo Inc | 29.606 |
| 150 | Accenture Plc - Class A | 28.332 |
| 171 | Automatic Data Processing Inc | 28.126 |
| 128 | American Tower Corp (REIT) | 27.598 |
| 239 | DSV PANALPINA A/S | 27.300 |
| 696 | AT&T Inc | 26.860 |
| 1.188 | Industrivarden AB | 26.845 |
| 500 | Blackstone Group Inc/The | 26.021 |
| 87 | Costco Wholesale Corp | 25.536 |
| 296 | Philip Morris International Inc | 25.531 |
| 121 | CME Group Inc | 24.586 |
| 300 | George Weston Ltd | 23.547 |
| 1.300 | Hydro One Ltd '144A' | 23.110 |
| 85 | MTU Aero Engines AG | 22.573 |

L&G Global Equity UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--|----------------|
| 2.969 | Wells Fargo & Co | 159.721 |
| 464 | Celgene Corp | 50.189 |
| 100 | Fairfax Financial Holdings Ltd | 45.248 |
| 349 | Groupe Bruxelles Lambert SA | 35.571 |
| 249 | Fidelity National Information Services Inc | 33.483 |
| 245 | Worldpay Inc - Class A | 33.363 |
| 451 | Anadarko Petroleum Corp | 32.830 |
| 600 | National Bank of Canada | 31.250 |
| 344 | Bayerische Motoren Werke AG | 27.755 |
| 620 | SS&C Technologies Holdings Inc | 27.408 |
| 423 | Investor AB | 21.975 |
| 908 | Industrivarden AB | 21.026 |
| 107 | Red Hat Inc | 20.330 |
| 9.634 | A2A SpA | 19.085 |
| 691 | Liberty Global Plc | 19.003 |
| 2.409 | Auto Trader Group Plc '144A' | 16.840 |
| 354 | Ramsay Health Care Ltd | 16.281 |
| 415 | Harley-Davidson Inc | 15.993 |
| 503 | Axalta Coating Systems Ltd | 14.345 |
| 110 | Federal Realty Investment Trust (REIT) | 14.202 |
| 101 | Walt Disney Co/The | 13.620 |
| 231 | Dow Inc | 12.538 |
| 209 | ASX Ltd | 12.108 |
| 242 | Kirkland Lake Gold Ltd | 11.315 |
| 366 | Viacom Inc | 9.566 |
| 72 | Total System Services Inc | 9.316 |
| 600 | Sumitomo Corp | 8.718 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Kosten € |
|---------|---|-------------|
| 8.831 | Alcon Inc | 464.895 |
| 7.066 | Prosus NV | 445.251 |
| 3.386 | Anheuser-Busch InBev SA/NV | 293.920 |
| 4.987 | Cellnex Telecom SA '144A' | 188.019 |
| 561 | Safran SA | 82.353 |
| 729 | DSV PANALPINA A/S | 69.962 |
| 3.336 | Industrivarden AB | 66.781 |
| 632 | Nestle SA | 60.425 |
| 3.253 | Amarin Corp Plc ADR | 51.351 |
| 519 | Solvay SA | 49.990 |
| 1.268 | Innogy SE | 48.377 |
| 656 | Bayerische Motoren Werke AG | 48.225 |
| 1.924 | Peugeot SA | 46.317 |
| 11.855 | Hera SpA | 45.476 |
| 4.439 | Adevinta ASA | 45.188 |
| 733 | Bakkafrost P/F | 44.585 |
| 2.676 | AAK AB | 44.562 |
| 4.786 | Electricite de France SA | 44.406 |
| 3.680 | FinecoBank Banca Fineco SpA | 39.970 |
| 1.486 | IMMOFINANZ AG | 38.489 |
| 748 | Investor AB | 35.095 |
| 289 | Air Liquide SA | 34.003 |
| 3.635 | Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A' | 33.095 |
| 1.746 | Infineon Technologies AG | 31.611 |
| 1.545 | Axfood AB | 30.278 |
| 3.103 | Nexi SpA '144A' | 30.163 |

L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse € |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 4.114 | Nestle SA | 394.026 |
| 4.015 | Novartis AG | 323.667 |
| 1.060 | Roche Holding AG | 269.011 |
| 11.965 | Engie SA | 159.426 |
| 2.100 | Sanofi | 154.398 |
| 1.234 | Air Liquide SA | 151.199 |
| 3.580 | Investor AB | 145.712 |
| 1.279 | SAP SE | 143.350 |
| 15.974 | Iberdrola SA | 140.461 |
| 2.827 | Daimler AG | 140.373 |
| 1.253 | NXP Semiconductors NV | 127.200 |
| 333 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 125.671 |
| 1.743 | Atos SE | 120.819 |
| 5.528 | AXA SA | 118.431 |
| 3.067 | Innogy SE | 116.206 |
| 2.559 | TOTAL SA | 112.360 |
| 523 | ASML Holding NV | 108.861 |
| 508 | Allianz SE | 102.585 |
| 4.644 | Industrivarden AB | 89.062 |
| 1.700 | Unilever NV | 88.117 |
| 1.588 | Ageas | 84.505 |
| 1.830 | Novo Nordisk A/S | 82.090 |
| 4.829 | Assicurazioni Generali SpA | 79.361 |
| 845 | Vinci SA | 79.325 |

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|---|----------------|
| 66.400 | AIA Group Ltd | 667.080 |
| 10.194 | Commonwealth Bank of Australia | 550.687 |
| 2.302 | CSL Ltd | 395.308 |
| 20.262 | Westpac Banking Corp | 375.012 |
| 15.039 | BHP Group Ltd | 374.196 |
| 18.261 | National Australia Bank Ltd | 335.165 |
| 16.345 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd | 291.004 |
| 7.866 | Wesfarmers Ltd | 219.043 |
| 8.264 | Woolworths Group Ltd | 214.379 |
| 6.800 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 213.799 |
| 107.623 | Geely Automobile Holdings Ltd | 208.440 |
| 72.390 | Telstra Corp Ltd | 179.394 |
| 9.800 | DBS Group Holdings Ltd | 176.363 |
| 2.000 | Macquarie Group Ltd | 176.332 |
| 20.885 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | 161.729 |
| 14.500 | Link REIT (Units) (REIT) | 157.547 |
| 17.000 | CK Hutchison Holdings Ltd | 150.133 |
| 7.900 | United Overseas Bank Ltd | 145.434 |
| 14.134 | Amcor Plc CDI | 142.656 |
| 9.000 | Sun Hung Kai Properties Ltd | 133.443 |
| 5.734 | Woodside Petroleum Ltd | 127.337 |
| 2.021 | Rio Tinto Ltd | 126.803 |
| 12.117 | Transurban Group | 124.468 |
| 62.000 | Hong Kong & China Gas Co Ltd | 120.902 |
| 5.078 | Newcrest Mining Ltd | 115.927 |
| 11.634 | Goodman Group (REIT) | 111.077 |
| 10.500 | CLP Holdings Ltd | 109.463 |

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|--------------------------------------|----------------|
| 29.661 | Amcor Plc CDI | 291.271 |
| 21.400 | CapitalLand Ltd | 57.599 |
| 18.000 | Hong Kong & China Gas Co Ltd | 38.559 |
| 1.590 | Woolworths Group Ltd | 38.138 |
| 38.510 | Evergrande Health Industry Group Ltd | 37.367 |
| 8.839 | Hysan Development Co Ltd | 35.774 |
| 10.880 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd | 31.046 |
| 2.000 | Sun Hung Kai Properties Ltd | 28.478 |
| 900 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 28.266 |
| 5.400 | Keppel Corp Ltd | 27.401 |
| 25.367 | Shangri-La Asia Ltd | 26.881 |
| 2.121 | Transurban Group | 21.720 |
| 2.500 | CK Hutchison Holdings Ltd | 21.556 |
| 14.700 | Mapletree Commercial Trust (REIT) | 21.346 |
| 1.623 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | 20.734 |
| 1.052 | Westpac Banking Corp | 19.924 |
| 16.000 | Sino Biopharmaceutical Ltd | 18.870 |
| 5.012 | Z Energy Ltd | 16.887 |
| 2.100 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | 16.795 |
| 95.244 | Golden Agri-Resources Ltd | 15.759 |
| 2.414 | Auckland International Airport Ltd | 14.809 |
| 261 | Commonwealth Bank of Australia | 13.878 |
| 441 | Wesfarmers Ltd | 11.525 |
| 600 | United Overseas Bank Ltd | 11.240 |
| 168 | Rio Tinto Ltd | 10.159 |

L&G Clean Water UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|---|----------------|
| 4.306 | Cadiz Inc | 53.855 |
| 5.280 | United Utilities Group Plc | 53.781 |
| 2.264 | National Oilwell Varco Inc | 51.029 |
| 310 | Rockwell Automation Inc | 51.007 |
| 8.104 | Outotec Oyj | 50.580 |
| 1.289 | Trimble Inc | 49.880 |
| 803 | LANXESS AG | 49.149 |
| 1.193 | SPX FLOW Inc | 47.950 |
| 1.625 | AquaVenture Holdings Ltd | 30.765 |
| 633 | Organo Corp | 29.400 |
| 3.028 | Energy Recovery Inc | 29.000 |
| 28.416 | China Water Affairs Group Ltd | 22.844 |
| 349 | Advanced Drainage Systems Inc | 12.852 |
| 441 | Severn Trent Plc | 12.706 |
| 546 | Alfa Laval AB | 12.550 |
| 906 | Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR | 12.278 |
| 297 | Pentair Plc | 12.263 |
| 164 | SJW Group | 12.164 |
| 208 | Badger Meter Inc | 12.086 |
| 222 | Franklin Electric Co Inc | 12.063 |
| 144 | Xylem Inc/NY | 11.991 |
| 181 | Middlesex Water Co | 11.954 |
| 134 | Tetra Tech Inc | 11.874 |
| 699 | Sekisui Chemical Co Ltd | 11.871 |
| 1.017 | Mueller Water Products Inc - Class A | 11.833 |
| 412 | Kurita Water Industries Ltd | 11.777 |
| 43 | IDEXX Laboratories Inc | 11.768 |
| 258 | Aqua America Inc | 11.670 |
| 5.405 | Guangdong Investment Ltd | 11.657 |
| 667 | Evoqua Water Technologies Corp | 11.580 |
| 151 | Itron Inc | 11.488 |
| 119 | Lindsay Corp | 11.374 |
| 284 | HD Supply Holdings Inc | 11.331 |
| 391 | Rexnord Corp | 11.326 |
| 16 | Mettler-Toledo International Inc | 11.301 |
| 207 | California Water Service Group | 11.293 |
| 93 | American Water Works Co Inc | 11.282 |
| 224 | AO Smith Corp | 11.197 |
| 110 | Sulzer AG | 11.119 |
| 456 | Halma Plc | 11.062 |
| 80 | Danaher Corp | 11.053 |
| 57 | Ecolab Inc | 11.030 |
| 124 | Kadant Inc | 10.970 |
| 2.803 | Rotork Plc | 10.902 |

L&G Clean Water UCITS ETF

Aufstellung wesentlicher Käufe (Fortsetzung)

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 32 | Roper Technologies Inc | 10.826 |
| 113 | Watts Water Technologies Inc - Class A | 10.607 |
| 49 | Waters Corp | 10.509 |
| 19.770 | Beijing Enterprises Water Group Ltd | 10.463 |
| 136 | Crane Co | 10.463 |
| 67 | IDEX Corp | 10.454 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 651 | Connecticut Water Service Inc | 45.573 |
| 3.285 | Uponor Oyj | 35.140 |
| 366 | Itron Inc | 28.121 |
| 292 | Tetra Tech Inc | 24.637 |
| 572 | Advanced Drainage Systems Inc | 18.737 |
| 68 | IDEXX Laboratories Inc | 18.642 |
| 971 | Evoqua Water Technologies Corp | 16.059 |
| 161 | Watts Water Technologies Inc - Class A | 15.260 |
| 322 | Aqua America Inc | 14.302 |
| 1.128 | Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR | 13.400 |
| 75 | IDEX Corp | 12.325 |
| 100 | American Water Works Co Inc | 12.282 |
| 483 | Halma Plc | 11.911 |
| 59 | Ecolab Inc | 11.567 |
| 155 | SJW Group | 10.524 |
| 69 | Danaher Corp | 10.106 |
| 28 | Roper Technologies Inc | 10.065 |
| 4.535 | Guangdong Investment Ltd | 9.059 |
| 314 | Kurita Water Industries Ltd | 8.475 |
| 767 | Mueller Water Products Inc - Class A | 8.421 |
| 2.118 | Rotork Plc | 8.394 |
| 298 | Rexnord Corp | 8.236 |
| 77 | Sulzer AG | 7.726 |
| 119 | Middlesex Water Co | 7.575 |
| 74 | Kadant Inc | 6.435 |
| 79 | Xylem Inc/NY | 6.120 |
| 8 | Mettler-Toledo International Inc | 5.673 |
| 99 | California Water Service Group | 5.255 |
| 51 | Lindsay Corp | 4.796 |
| 58 | Crane Co | 4.676 |
| 280 | Sekisui Chemical Co Ltd | 4.526 |

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|--------------------------------------|----------------|
| 295 | Arista Networks Inc | 63.899 |
| 1.880 | Veracyte Inc | 53.620 |
| 1.016 | Rapid7 Inc | 53.463 |
| 965 | iRobot Corp | 48.593 |
| 941 | Grubhub Inc | 44.462 |
| 136 | Illumina Inc | 43.086 |
| 3.253 | Blue Prism Group plc | 42.267 |
| 607 | New Relic Inc | 40.438 |
| 397 | Xilinx Inc | 37.468 |
| 2.086 | Nuance Communications Inc | 35.231 |
| 219 | HubSpot Inc | 33.897 |
| 2.241 | Intellia Therapeutics Inc | 33.441 |
| 236 | Splunk Inc | 33.186 |
| 321 | Alteryx Inc - Class A | 33.097 |
| 1.484 | Infineon Technologies AG | 31.331 |
| 270 | Baidu Inc ADR | 31.002 |
| 738 | SoftBank Group Corp | 30.798 |
| 1.125 | Teradata Corp | 30.084 |
| 201 | Veeva Systems Inc - Class A | 29.363 |
| 138 | NVIDIA Corp | 29.286 |
| 97 | Netflix Inc | 28.742 |
| 3.454 | Global Unichip Corp | 28.697 |
| 213 | International Business Machines Corp | 28.594 |
| 164 | Autodesk Inc | 28.179 |
| 16 | Amazon.com Inc | 28.117 |
| 186 | Microsoft Corp | 28.091 |
| 21 | Alphabet Inc - Class A | 28.042 |
| 232 | Wix.com Ltd | 27.927 |
| 882 | Nutanix Inc | 27.675 |
| 358 | Zendesk Inc | 27.254 |
| 171 | salesforce.com Inc | 27.232 |

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe (Fortsetzung)**

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|---|----------------|
| 1.654 | Appen Ltd | 26.931 |
| 75 | Fair Isaac Corp | 26.845 |
| 264 | Twilio Inc - Class A | 26.720 |
| 622 | Tencent Holdings Ltd | 26.699 |
| 181 | Verisk Analytics Inc - Class A | 26.541 |
| 95 | ASML Holding NV NY Reg Shrs | 26.236 |
| 2.721 | Sage Group Plc/The | 25.889 |
| 98 | Intuit Inc | 25.643 |
| 331 | Varonis Systems Inc | 25.047 |
| 375 | Square Inc | 24.756 |
| 597 | Yandex NV - Class A | 24.023 |
| 123 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | 23.867 |
| 165 | Spotify Technology SA | 23.816 |
| 86 | Lam Research Corp | 23.462 |
| 87 | ServiceNow Inc | 23.367 |
| 233 | Electronic Arts Inc | 23.335 |
| 99 | Palo Alto Networks Inc | 23.111 |
| 67 | Tesla Inc | 22.980 |
| 113 | Accenture Plc - Class A | 22.682 |
| 2.235 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 22.580 |
| 192 | Analog Devices Inc | 21.841 |
| 328 | Teradyne Inc | 21.007 |
| 180 | Proofpoint Inc | 20.881 |
| 58 | Shopify Inc | 20.795 |
| 415 | Cognex Corp | 20.776 |
| 173 | Capgemini SE | 20.636 |
| 171 | Aspen Technology Inc | 20.512 |
| 334 | Cornerstone OnDemand Inc | 20.144 |
| 612 | JD.com Inc ADR | 20.142 |
| 1.340 | Yext Inc | 19.846 |
| 65 | Adobe Inc | 19.752 |

L&G Artificial Intelligence UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|---|----------------|
| 226 | salesforce.com Inc | 35.196 |
| 337 | Medidata Solutions Inc | 30.918 |
| 66 | Tesla Inc | 23.963 |
| 2.292 | Cloudera Inc | 22.141 |
| 137 | Splunk Inc | 20.642 |
| 1.988 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 18.900 |
| 537 | Nutanix Inc | 17.000 |
| 62 | ASML Holding NV NY Reg Shrs | 16.672 |
| 77 | NVIDIA Corp | 16.430 |
| 123 | Alteryx Inc - Class A | 14.508 |
| 213 | Teradyne Inc | 13.367 |
| 64 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | 12.661 |
| 35 | Illumina Inc | 11.554 |
| 152 | New Relic Inc | 10.335 |
| 146 | Varonis Systems Inc | 10.251 |
| 758 | Blue Prism Group plc | 9.882 |
| 54 | Autodesk Inc | 9.873 |
| 32 | Lam Research Corp | 9.330 |
| 510 | Nuance Communications Inc | 9.139 |
| 7 | Alphabet Inc - Class A | 9.094 |
| 366 | Infineon Technologies AG | 8.288 |
| 61 | Baidu Inc ADR | 7.776 |
| 71 | Fiserv Inc | 7.553 |
| 49 | Microsoft Corp | 7.407 |
| 142 | Cognex Corp | 7.315 |
| 22 | Shopify Inc | 7.014 |
| 434 | Intellia Therapeutics Inc | 6.714 |
| 803 | Global Unichip Corp | 6.500 |
| 102 | Cornerstone OnDemand Inc | 5.808 |
| 18 | Fair Isaac Corp | 5.620 |
| 39 | Proofpoint Inc | 4.972 |
| 23 | Palo Alto Networks Inc | 4.963 |
| 42 | Analog Devices Inc | 4.884 |
| 30 | Verisk Analytics Inc - Class A | 4.752 |

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|---|----------------|
| 1.751 | Vocera Communications Inc | 45.103 |
| 210 | Insulet Corp | 32.720 |
| 7.040 | Fluidigm Corp | 31.348 |
| 446 | Glaukos Corp | 31.223 |
| 56 | Eurofins Scientific SE | 30.791 |
| 365 | CRISPR Therapeutics AG | 24.843 |
| 810 | Grifols SA | 23.620 |
| 211 | CONMED Corp | 23.300 |
| 147 | IQVIA Holdings Inc | 22.959 |
| 258 | Exact Sciences Corp | 22.845 |
| 433 | Tabula Rasa HealthCare Inc | 21.483 |
| 101 | ABIOMED Inc | 20.782 |
| 92 | Align Technology Inc | 19.002 |
| 157 | Alnylam Pharmaceuticals Inc | 18.202 |
| 539 | Natera Inc | 17.119 |
| 965 | Axogen Inc | 16.157 |
| 116 | Varian Medical Systems Inc | 15.149 |
| 49 | Illumina Inc | 14.938 |
| 92 | Penumbra Inc | 14.824 |
| 325 | Boston Scientific Corp | 14.353 |
| 702 | Invitae Corp | 13.974 |
| 483 | CryoLife Inc | 13.788 |
| 437 | HMS Holdings Corp | 13.726 |
| 273 | BioTelemetry Inc | 12.041 |
| 324 | QIAGEN NV | 12.024 |
| 165 | iRhythm Technologies Inc | 12.006 |
| 634 | Materialise NV ADR | 11.931 |
| 261 | Cardiovascular Systems Inc | 11.871 |
| 2.372 | Ping An Healthcare and Technology Co Ltd '144A' | 11.808 |
| 32 | Lonza Group AG | 11.119 |
| 2.325 | Cerus Corp | 10.996 |
| 50 | Stryker Corp | 10.513 |

L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF**Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|------------------------------------|----------------|
| 1.214 | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | 71.254 |
| 617 | Genomic Health Inc | 40.450 |
| 378 | Medidata Solutions Inc | 34.679 |
| 101 | Waters Corp | 23.537 |
| 651 | Avanos Medical Inc | 21.234 |
| 214 | Nevro Corp | 20.606 |
| 104 | DexCom Inc | 18.889 |
| 924 | Nektar Therapeutics | 18.617 |
| 102 | Veeva Systems Inc - Class A | 15.261 |
| 52 | Align Technology Inc | 14.189 |
| 165 | Medpace Holdings Inc | 14.024 |
| 145 | Teladoc Health Inc | 11.287 |
| 178 | Tabula Rasa HealthCare Inc | 10.133 |
| 107 | Novocure Ltd | 8.706 |
| 86 | Exact Sciences Corp | 8.589 |
| 231 | STAAR Surgical Co | 8.285 |
| 122 | Integra LifeSciences Holdings Corp | 7.449 |
| 130 | Globus Medical Inc | 6.899 |
| 96 | Tactile Systems Technology Inc | 6.653 |
| 17 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 6.385 |
| 28 | Edwards Lifesciences Corp | 6.150 |
| 38 | Penumbra Inc | 6.067 |
| 327 | Materialise NV ADR | 5.892 |
| 156 | HMS Holdings Corp | 5.787 |
| 16 | Bio-Rad Laboratories Inc | 5.606 |
| 32 | CSL Ltd | 5.438 |

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Kosten € |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 87.650 | Nestle SA | 8.960.634 |
| 20.235 | Roche Holding AG | 5.077.528 |
| 589.888 | HSBC Holdings Plc | 3.949.735 |
| 30.611 | SAP SE | 3.370.950 |
| 38.161 | AstraZeneca Plc | 3.106.177 |
| 7.734 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 2.876.897 |
| 145.069 | GlaxoSmithKline Plc | 2.788.608 |
| 15.758 | Linde Plc | 2.692.760 |
| 68.849 | Diageo Plc | 2.692.555 |
| 32.493 | Sanofi | 2.628.545 |
| 12.294 | ASML Holding NV | 2.598.378 |
| 12.264 | Allianz SE | 2.489.668 |
| 42.125 | Unilever NV | 2.381.638 |
| 48.452 | Novo Nordisk A/S | 2.314.419 |
| 22.060 | Siemens AG | 2.046.016 |
| 28.536 | Bayer AG | 1.921.857 |
| 32.828 | Unilever Plc | 1.900.435 |
| 22.317 | Anheuser-Busch InBev SA/NV | 1.897.531 |
| 7.116 | L'Oreal SA | 1.799.077 |
| 180.975 | Iberdrola SA | 1.701.948 |

Aufstellung wesentlicher Verkäufe

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse € |
|---------|----------------------------------|-------------|
| 3.791 | Nestle SA | 366.729 |
| 19.660 | ArcelorMittal SA | 324.688 |
| 18.069 | Danske Bank A/S | 231.256 |
| 9.095 | BHP Group Plc | 185.086 |
| 3.359 | Innogy SE | 126.265 |
| 2.419 | Unilever NV | 123.798 |
| 2.445 | Daimler AG | 117.136 |
| 19.687 | Merlin Entertainments Plc '144A' | 104.083 |
| 1.135 | Akzo Nobel NV | 101.838 |
| 1.533 | BB Biotech AG | 95.700 |
| 335 | L'Oreal SA | 86.727 |
| 1.336 | Axel Springer SE | 83.496 |
| 8.401 | Greene King Plc | 82.823 |
| 11.924 | Inmarsat Group Holdings Ltd | 75.978 |
| 3.258 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | 74.018 |
| 13.342 | Snam SpA | 61.637 |
| 19.306 | Balfour Beatty Plc | 60.411 |
| 885 | Gerresheimer AG | 60.310 |
| 301 | Rockwool International A/S | 56.911 |
| 178 | Bucher Industries AG | 55.249 |

* Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung wesentlicher Käufe**

| Nominal | Bezeichnung | Kosten US\$ |
|---------|----------------------------------|----------------|
| 84.801 | Apple Inc | 22.382.240 |
| 141.382 | Microsoft Corp | 21.321.685 |
| 7.826 | Amazon.com Inc | 14.022.637 |
| 44.697 | Facebook Inc - Class A | 8.933.953 |
| 6.245 | Alphabet Inc | 8.136.856 |
| 59.547 | JPMorgan Chase & Co | 7.815.488 |
| 5.494 | Alphabet Inc - Class A | 7.154.981 |
| 31.765 | Berkshire Hathaway Inc - Class B | 7.154.153 |
| 32.369 | Visa Inc - Class A | 5.912.500 |
| 174.684 | Bank of America Corp | 5.810.136 |
| 46.948 | Procter & Gamble Co/The | 5.747.824 |
| 137.087 | AT&T Inc | 5.138.612 |
| 33.759 | Walt Disney Co/The | 5.083.608 |
| 17.671 | UnitedHealth Group Inc | 4.942.027 |
| 16.701 | Mastercard Inc | 4.821.099 |
| 83.155 | Intel Corp | 4.805.228 |
| 77.587 | Verizon Communications Inc | 4.657.194 |
| 20.543 | Home Depot Inc/The | 4.495.803 |
| 79.691 | Coca-Cola Co/The | 4.291.573 |
| 48.027 | Merck & Co Inc | 4.195.009 |

* Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF***Aufstellung wesentlicher Verkäufe**

| Nominal | Bezeichnung | Erlöse US\$ |
|---------|----------------------------------|----------------|
| 3.703 | Apple Inc | 1.036.841 |
| 13.781 | Truist Financial Corp | 773.611 |
| 3.460 | Microsoft Corp | 538.719 |
| 3.068 | Vulcan Materials Co | 434.736 |
| 11.041 | Bank of America Corp | 385.856 |
| 284 | Alphabet Inc - Class A | 385.202 |
| 2.781 | JPMorgan Chase & Co | 381.943 |
| 21.192 | Snap Inc | 327.605 |
| 152 | Amazon.com Inc | 272.407 |
| 5.618 | E*TRADE Financial Corp | 258.017 |
| 8.728 | Elanco Animal Health Inc | 252.658 |
| 3.134 | CH Robinson Worldwide Inc | 240.455 |
| 883 | FactSet Research Systems Inc | 238.234 |
| 5.102 | CF Industries Holdings Inc | 236.614 |
| 12.006 | Mylan NV | 232.660 |
| 3.220 | Booz Allen Hamilton Holding Corp | 228.153 |
| 1.744 | Federal Realty Investment Trust | 222.990 |
| 3.818 | Intel Corp | 221.276 |
| 4.083 | Molson Coors Beverage Co | 217.404 |
| 1.043 | Facebook Inc - Class A | 214.905 |
| 2.666 | Citigroup Inc | 208.466 |
| 2.234 | QUALCOMM Inc | 197.673 |
| 823 | Lennox International Inc | 196.156 |
| 1.043 | Visa Inc - Class A | 194.547 |
| 10.154 | Avantor Inc | 180.931 |

* Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

