

# Legal & General UCITS ETF Plc

Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss  
für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020

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



# Inhalt

## Jahresbericht und geprüfter Jahresabschluss der Legal & General UCITS ETF Plc

Inhaltsverzeichnis	1
Verwaltungsrat und sonstige Informationen	2
Informationen über die Gesellschaft	4
Fondsbericht	9
Bericht des Verwaltungsrats	15
Bericht des Prüfungsausschusses	52
Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber vom 30. Juni 2020	56
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	57

## Jahresabschluss der Gesellschaft

Bilanz der Gesamtgesellschaft	65
Gesamtergebnisrechnung der Gesamtgesellschaft	66
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens der Gesamtgesellschaft	67
Kapitalflussrechnung der Gesamtgesellschaft	68

## Jahresabschlüsse der Fonds

Bilanz	
zum 30. Juni 2020	69
Vergleichsdaten zum 30. Juni 2019	73
Gesamtergebnisrechnung	
für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020	78
Vergleichsdaten für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019	82
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	
für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020	87
Vergleichsdaten für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019	89
Anmerkungen zum Jahresabschluss	92

## Sonstige Informationen - ungeprüft

Aufstellung der Vermögenswerte	190
OGAW-V-Vergütungspolitik	401
Value-at-Risk-Bericht („VaR“-Bericht)	402
Weitere Informationen	403
Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	405
Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe	416

## Verwaltungsrat und sonstige Informationen

### Verwaltungsrat:

Mark Weeks (UK) (zurückgetreten am 31. März 2020)  
Eimear Cowhey (Irin)<sup>(1)</sup>  
Adrian Waters (Ire)<sup>(1)</sup>  
Amy Ellison (Britin)  
Feargal Dempsey (Ire)<sup>(1)(2)</sup>  
(ernannt am 14. Januar 2020)  
Howie Li (Brite) (ernannt am 23. März 2020)  
Patrizia Libotte (Irin) (ernannt am 23. Juni 2020)  
David Fagan (Ire) (ernannt am 16. Juli 2020)<sup>(1)</sup>

Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführend

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

<sup>(2)</sup> Vorsitzender

### Verwaltungsgesellschaft:

LGIM ETF Managers Limited  
(bis 31. März 2020)  
2 Grand Canal Square  
Dublin 2  
D02 A342  
Irland

LGIM Managers (Europe) Limited  
(wirksam zum 31. März 2020)  
33/34 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2  
D02 XK09  
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  
Riverside II, Sir John Rogerson's Quay  
Grand Canal Dock  
Dublin 2  
D01 E4X0  
Irland

### Registerstelle:

Computershare Investor Services (Ireland) Limited  
(bis 20. April 2020)  
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, Transfer- und Registerstelle:

BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company  
(Registerstelle mit Wirkung vom 20. April 2020)  
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  
(bis 1. April 2020)  
1 Harbourmaster Place  
International Financial Services Centre  
Dublin 1  
D01 F6F5  
Irland

## Verwaltungsrat und sonstige Informationen (Fortsetzung)

### Unabhängige Abschlussprüfer (Fortsetzung):

Ernst & Young  
(wirksam zum 1. April 2020)  
Chartered Accountants & Registered Auditors  
Harcourt Centre  
Harcourt Street  
Dublin 2  
D02 YA40  
Irland

### Rechtsberater in Irland:

William Fry  
2 Grand Canal Square  
Dublin 2  
D02 A342  
Irland

### 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

### Lokale Zahlstelle und Vertretung in der Schweiz:

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

Registernummer: 459936

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

## Informationen über die Gesellschaft

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

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

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

Zum 30. Juni 2020 waren die folgenden 39 Fonds der Gesellschaft von der Zentralbank genehmigt, von denen 27 am Ende des Geschäftsjahres für Zeichnungen zur Verfügung standen und ihre Geschäftstätigkeit ausübten. Die von den einzelnen Fonds jeweils nachgebildeten/replizierten Indizes sind ebenfalls nachstehend aufgeführt:

Name des Fonds	Fondsart	Indexname
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 Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup>	"	LOIM Fundamental Euro Corporate Index
L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup>	"	LOIM Fundamental Global Corporate Index
L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup>	"	LOIM Fundamental Global Government Index
L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup>	"	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 <sup>2</sup>	"	Solactive Core Germany Large & Mid Cap Index NTR
L&G Italy Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	"	Solactive Core Italy Large & Mid Cap Index NTR
L&G Switzerland Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	"	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 <sup>3</sup>	"	Foxberry Sustainability Consensus Europe TR Index
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>4</sup>	"	Foxberry Sustainability Consensus US TR Index

<sup>1</sup>Zwangweise 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. Am 1. September 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für diese Fonds.

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

<sup>3</sup>Dieser Fonds wurde durch die Zentralbank am 6. August 2019 zugelassen. Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

<sup>4</sup>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 <sup>5</sup>	"	Foxberry Floored Beta US Large Cap @80% TR Index
L&G Foxberry EU Large Cap Floored UCITS ETF <sup>5</sup>	"	Foxberry Floored Beta EU Large Cap @80% TR Index
L&G Foxberry Germany Large Cap Floored UCITS ETF <sup>5</sup>	"	Foxberry Floored Beta Germany Large Cap @80% TR Index
L&G Foxberry Emerging Markets Floored UCITS ETF <sup>5</sup>	"	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 <sup>6</sup>	"	Barclays Backwardation Tiit Multi-Strategy Capped Total Return Index

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

<sup>6</sup>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, ist in der Anlagestrategie des betreffenden Fonds im fondsspezifischen Nachtrag zum Verkaufsprospekt der Gesellschaft beschrieben.

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

\*Diese Angaben gelten als wesentlicher Bestandteil dieser Jahresberichte.

In nachstehender Tabelle sind die Wertpapierbörsen aufgeführt, an denen die einzelnen Fonds (bzw. deren Anteilklassen, sofern sich der betreffende Fonds aus mehr als einer Anteilklasse zusammensetzt) am 30. Juni 2020 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
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓	X
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	✓	✓	✓	✓	✓	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
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	✓	X	✓	✓	✓	X
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup>	✓	X	✓	✓	X	X
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>2</sup>	✓	X	✓	✓	X	X

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

<sup>2</sup> 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 bis zum 31. März 2020 auf die LGIM ETF Managers Limited und mit Wirkung vom 31. März 2020 auf die LGIM Managers (Europe) 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 das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020“ bezieht sich auf den zwölfmonatigen Berichtszeitraum vom 1. Juli 2019 bis zum 30. Juni 2020.

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

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

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

## Fondsbericht

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

Fonds	Währung	Auflegungsdatum	TER	NIW zum 30.06.2020 Gesamt	NIW zum 30.06.2020 Je Anteil	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2020 NIW/Anteil Veränderung in %	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2020 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	USD	14.05.2014	0,88 %	27.517.011	15,9057	10,42 %	12,19 %	-1,77 %	2,00 %	0,61 %	139,03
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF <sup>3</sup>	EUR	18.06.2009	0,40 %	30.354.290	252,5126	-11,76 %	-10,62 %	-1,14 %	0,08 %	0,10 %	-2,11
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF <sup>3</sup>	EUR	18.06.2009	0,60 %	67.772.133	3,1327	-25,74 %	-25,16 %	-0,58 %	0,09 %	0,10 %	-0,83
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF <sup>3</sup>	USD	15.03.2010	0,30 %	439.243.546	12,1695	-11,94 %	-11,59 %	-0,35 %	0,03 %	0,08 %	-5,35
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF <sup>3</sup>	GBP	18.06.2009	0,50 %	12.487.709	215,7330	-33,23 %	-32,03 %	-1,20 %	0,10 %	0,13 %	-2,86
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF <sup>3</sup>	GBP	18.06.2009	0,60 %	26.073.456	7,7838	8,04 %	8,94 %	-0,90 %	0,08 %	0,09 %	-1,35
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	USD	11.09.2008	0,45 %	48.856.605	60,7845	-7,11 %	-7,02 %	-0,09 %	0,02 %	0,02 %	-0,42
L&G Gold Mining UCITS ETF <sup>3</sup>	USD	11.09.2008	0,65 %	273.800.641	36,2069	38,89 %	40,52 %	-1,63 %	0,05 %	0,06 %	-0,82
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF <sup>2,3</sup>	USD	12.05.2014	0,25 %	13.578.782	2,7649	-41,54 %	-41,23 %	-0,31 %	0,08 %	0,15 %	-7,39
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	USD	23.10.2014	0,80 %	816.606.435	17,2168	9,77 %	10,12 %	-0,35 %	1,00 %	0,19 %	80,79
L&G Cyber Security UCITS ETF	USD	22.09.2015	0,75 %	1.547.753.663	18,9822	19,58 %	20,25 %	-0,67 %	1,00 %	0,42 %	57,99
L&G All Commodities UCITS ETF	USD	05.07.2017	0,15 %	50.460.470	8,1502	-17,57 %	-17,38 %	-0,19 %	0,03 %	0,02 %	1,00
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	USD	05.07.2017	0,30 %	7.801.655	9,8606	-11,31 %	-10,96 %	-0,35 %	0,03 %	0,03 %	0,32
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	USD	18.01.2018	0,49 %	111.264.445	9,1575	13,02 %	12,87 %	0,15 %	0,75 %	0,45 %	29,53
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	USD	18.01.2018	0,49 %	25.643.912	11,9274	21,59 %	22,25 %	-0,66 %	0,75 %	0,09 %	66,42
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	USD	18.01.2018	0,49 %	58.987.801	10,6284	12,58 %	13,16 %	-0,58 %	0,75 %	0,08 %	66,51
L&G US Equity UCITS ETF	USD	07.11.2018	0,05 %	137.286.308	11,6667	8,67 %	8,44 %	0,23 %	2,00 %	0,07 %	193,00
L&G UK Equity UCITS ETF <sup>3</sup>	GBP	07.11.2018	0,05 %	10.962.695	9,1355	-15,05 %	-14,94 %	-0,11 %	0,50 %	0,54 %	-3,98
L&G Japan Equity UCITS ETF	USD	07.11.2018	0,10 %	116.469.371	10,4129	3,21 %	3,19 %	0,02 %	2,00 %	0,16 %	183,93
L&G Global Equity UCITS ETF	USD	07.11.2018	0,10 %	32.552.079	11,2248	3,48 %	3,14 %	0,34 %	2,00 %	0,28 %	172,39
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	EUR	07.11.2018	0,10 %	99.876.259	10,6694	-1,60 %	-1,77 %	0,17 %	2,00 %	0,09 %	190,52

## Fondsbericht (Fortsetzung)

Fonds	Währung	Auflegungsdatum	TER	NIW zum 30.06.2020 Gesamt	NIW zum 30.06.2020 Je Anteil	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2020 NIW/Anteil Veränderung in %	Wertentwicklung für das Geschäftsjahr zum 30.06.2020 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	USD	07.11.2018	0,10 %	47.377.214	10,2867	-11,03 %	-11,18 %	0,15 %	2,00 %	0,20 %	180,32
L&G Clean Water UCITS ETF	USD	25.06.2019	0,49 %	15.520.613	10,3470	2,24 %	2,53 %	-0,29 %	0,75 %	0,16 %	58,84
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	USD	26.06.2019	0,49 %	82.834.267	12,7515	28,96 %	29,56 %	-0,60 %	0,75 %	0,15 %	59,74
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	USD	26.06.2019	0,49 %	33.256.148	12,5494	24,27 %	24,87 %	-0,60 %	0,75 %	0,08 %	66,95
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1,2</sup>	EUR	30.08.2019	0,16 %	92.898.894	10,0977	0,98 %	0,24 %	0,74 %	2,00 %	0,29 %	171,22
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1,2</sup>	USD	26.11.2019	0,12 %	602.438.807	10,4954	4,95 %	3,96 %	0,99 %	2,00 %	0,06 %	193,89

<sup>1</sup> Angaben zu NIW, Wertentwicklung und Tracking Error beziehen sich auf den Berichtszeitraum vom angegebenen Auflegungsdatum der einzelnen Fonds bis zum 30. Juni 2020.

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

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

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 12 zu entnehmen.

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

## Fondsbericht (Fortsetzung)

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

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

### Marktkommentar – Juni 2020

#### Wirtschaftlicher Überblick

Vor Februar hatten globale Konjunkturindikatoren gezeigt, dass die Industrietätigkeit weltweit nach vorangegangenen Rückschlägen infolge des Handelsdisputs zwischen den USA und China allmählich wieder etwas an Dynamik gewann. Nachfolgende Konjunkturindikatoren haben jedoch die zunehmend schädlicheren Auswirkungen von Eindämmungsmaßnahmen betont, die zur Kontrolle der Ausweitung des COVID-19-Virus eingeführt wurden. Innerhalb nur weniger Monate erlebte der aufmerksam verfolgte globale zusammengesetzte Einkaufsmanagerindex für das produzierende Gewerbe („PMI“) einen plötzlichen Einbruch und fiel im April fast auf Niveaus, die es zuletzt im globalen Abschwung 2008/9 gab. Weltweit ist der Inflationsdruck im historischen Vergleich weiter gedämpft. Vor allem fiel der Ölpreis im März auf ein 18-Jahrestief, beeinträchtigt durch einen drastischen Nachfragerückgang infolge des durch die Lockdowns niedrigeren Verbrauchs, der durch die bis vor kurzem nicht gelungene Einigung auf Förderbegrenzungen zwischen der OPEC und Russland verstärkt wurde.

In den USA wuchs die Wirtschaft im Jahresverlauf 2019 um 2,3 %, was die geringste Wachstumsrate seit 2016 war und das Ziel der Trump-Regierung von 3 % das zweite Jahr verfehlte. Die US-Notenbank Federal Reserve („Fed“) senkte die US-Zinsen bis Ende 2019 auf 1,75 %, aber die Auswirkungen des Coronavirus veranlassten die Fed, ihre gesamte Feuerkraft zur Unterstützung der US-Wirtschaft einzusetzen. Im März senkte die Fed die Zinsen erst das zweite Mal in ihrer Geschichte auf Null und kündigte ein weiteres 700 Mrd. US\$ schweres quantitatives Lockerungsprogramm („QE“) an. Präsident Trump machte eine historisches Konjunkturprogramm in Höhe von 2,2 Bio. US\$ zum Gesetz, das die US-Wirtschaft unterstützen soll, nachdem mehr als 3 Millionen Amerikaner einen Antrag auf Arbeitslosenunterstützung gestellt hatten, ein Rekordhoch. Die endgültige Schätzung zum Bruttoinlandsprodukt zeigte, dass die US-Wirtschaft im ersten Quartal 2020 um einen annualisierten Satz von 5 % geschrumpft war, das kräftigste Schrumpfungstempo seit dem Schlussquartal 2008.

## Fondsbericht (Fortsetzung)

### Marktkommentar – Juni 2020 (Fortsetzung)

#### Wirtschaftlicher Überblick (Fortsetzung)

Bereits vor dem Ausbruch von COVID-19 ging die Dynamik in der Eurozone kräftig zurück. Die Produktionstätigkeit in Deutschland ging im letzten Herbst auf ihren niedrigsten Stand seit Mitte 2009 zurück, da die exportabhängige Wirtschaft des Landes weiter unter den globalen Handelsspannungen und dem sich abschwächenden Wachstum gelitten hat. Als Reaktion nahm die Europäische Zentralbank („EZB“) ihre quantitative Lockerung („QE“) im November wieder auf und legte im März ein neues 750 Mrd. € schweres Anleihenkaufprogramm auf, das sie kürzlich um weitere 600 Mrd. € erhöhte, um den ersten Gefahren für die Wirtschaft infolge des Coronavirus-Ausbruchs entgegenzuwirken. Nach vorläufigen Schätzungen schrumpfte die Wirtschaft der Eurozone im ersten Quartal 2020 im bisher schnellsten Tempo, da Frankreich, Italien und Spanien, drei der vier größten Volkswirtschaften der Währungsunion allesamt schrumpften.

Im Vereinigten Königreich belastete die politische Pattsituation über den Großteil des Berichtszeitraums die Konjunktur, insbesondere Unternehmensinvestitionen, und es bestand Unsicherheit in Bezug auf den Ausgang der Brexit-Verhandlungen und die Auswirkungen auf den künftigen Handel mit der EU. Die britische Regierung einigte sich schließlich im Oktober auf ein überarbeitetes Austrittsabkommen mit der EU, was den Weg für eine Parlamentswahl im Dezember ebnete. Da im März zur Eindämmung der Ausbreitung von COVID-19 ein Lockdown im Land erfolgte, senkte die Bank of England die Zinsen auf 0,1 % und nahm ihr QE-Programm wieder auf. Indessen kündigte die Regierung zusätzliche Staatsausgaben in Höhe von mindestens 80 Mrd. £ zur Absicherung von Unternehmen, Mitarbeitern und Selbstständigen gegen einen Konjunkturreinbruch an. Dennoch verzeichnete die britische Wirtschaft im ersten Quartal aufgrund der Auswirkungen des Lockdowns ihr kräftigstes Schrumpfungstempo seit 1979.

Mit Blick auf die asiatischen Volkswirtschaften rutschte Japan erstmals seit 2015 in eine Rezession, da die COVID-19-Krise die Konjunktur und Nachfrage stark belastete und die Auswirkung einer im letzten Herbst erfolgten Mehrwertsteuererhöhung verstärkte. Indessen meldeten die exportabhängigen Volkswirtschaften von Taiwan und Südkorea einen kräftigen Rückgang der Produktionstätigkeit. Die chinesische Wirtschaft verbuchte in den drei Monaten bis März ihre bisher erste Quartalsschrumpfung, wobei der Caixin General Composite PMI im Februar den bisher kräftigsten Rückgang in den privatwirtschaftlichen Aktivitäten aufzeigte. Danach kam es aufgrund der gelockerten Lockdown-Maßnahmen und des Wiederhochfahrens der Wirtschaft zu einer starken Erholung der chinesischen Konjunkturindikatoren. Neben anderen großen Schwellennationen senkten Brasilien, Indien und Russland die Zinsen, um dem nachlassenden Wirtschaftswachstum entgegenzusteuern.

#### Aktien

Globale Aktienindizes verbuchten einen mäßigen Gewinn im Berichtszeitraum und erholten sich von einem turbulenten ersten Quartal 2020, in dem sich COVID-19 weltweit ausbreitete und Länder Lockdown-Maßnahmen mit Schließungen von Industrien und Unternehmen einführten und den Bewegungen der Bevölkerung strikte Beschränkungen auferlegten. Ende Februar und Anfang März brachen die Märkte infolge zunehmender Befürchtungen einer schweren globalen Wirtschaftsrezession ein, obwohl Aktien sich anschließend im zweiten Quartal erholten, nachdem Zentralbanken und Regierungen weltweit eine umfassende Reihe an geld- und fiskalpolitischen Konjunkturprogrammen zur Unterstützung der Weltwirtschaft ankündigten.

## Fondsbericht (Fortsetzung)

### Marktkommentar – Juni 2020 (Fortsetzung)

#### Aktien (Fortsetzung)

Dennoch waren die Renditen britischer Aktien im Berichtszeitraum besonders enttäuschend. Im gesamten zweiten Halbjahr 2019 hatte die Unsicherheit bezüglich der Brexit-Verhandlungen den Markt überschattet, bevor ein haushoher Sieg für die Konservativen bei der Parlamentswahl im Dezember eine Rally im vierten Quartal einläutete, insbesondere unter mehr inländisch ausgerichteten kleineren Unternehmen, die zuvor eine Underperformance gegenüber dem breiteren FTSE All Share Index verzeichneten. In den Anfangsmonaten 2020 verbuchte der britische Markt jedoch seine schlechteste Quartalsperformance seit 1987, wobei kleinere Unternehmen besonders hart von der Verkaufswelle getroffen wurden. Die Auswirkungen von COVID-19 waren stark für Sektoren wie Einzelhändler, Finanzunternehmen, Industrie und Immobilien, da eine Reihe von Unternehmen sich auf eine Aussetzung von Dividendenzahlungen verlegten und sich für den Kapitalerhalt entschieden.

US-Aktien übertrafen globale Aktien in Pfund Sterling, und der US-Dollar profitierte in Phasen von Marktstress und -unruhe von seinem Status als Reservewährung. Da Anleger die Gewinnerwartungen als Reaktion auf COVID-19 deutlich zurückgeschraubt haben, wurde der Markt durch die Stärke von Technologieaktien mit großer Marktkapitalisierung angeführt, unterstützt durch Optimismus bezüglich der Nachhaltigkeit des Gewinnwachstums und der Nachfrage nach IT-Produkten und -Dienstleistungen. Auch die Gesundheitsbranche und Kommunikationsdienstleistungen erzielten eine Outperformance, da das Gewinnprofil dieser Sektoren weniger empfindlich auf einen Abschwung in der Wirtschaft reagiert. Demgegenüber brachen Energieaktien am stärksten im Berichtszeitraum ein, denn die Schwäche des Ölpreises veranlasste US-Produzenten die Anzahl der in Betrieb befindlichen Bohranlagen zu verringern und Pläne für Investitionsausgaben zu reduzieren.

Europäische Aktien konnten infolge wieder auflebender politischer Sorgen kaum Fortschritte erzielen. Dies bezog sich hauptsächlich auf Italien, wo die regierende Koalition auseinanderbrach und anschließend eine neue Regierung gebildet wurde. In den ersten Monaten 2020 kam es zu einem kräftigen Kurseinbruch auf den Märkten, und Italien und Spanien waren am stärksten von COVID-19 betroffen. Da Anleger sich zunehmend mit den Auswirkungen des Coronavirus auf Unternehmensgewinne und dem Risiko eines starken Konjunkturabschwungs beschäftigten, erlebten zyklische Sektoren und vor allem Finanz- und Industrietitel eine kräftige Verkaufswelle. Bei Finanztiteln waren Banken besonders schwach, da die EZB vorschrieb, dass Kreditgeber Dividendenzahlungen und Aktienrückkäufe zwecks Kapitalerhalt zurückstellen sollten. Anleger suchten Zuflucht in Basiskonsumgütern und Gesundheitsdienstleistern, welche die Verkaufswelle relativ gut überstanden.

Die asiatisch-pazifischen Märkte stiegen, blieben aber leicht hinter den globalen Märkten zurück. Nachdem sie Sorgen um zunehmende globale Handelsspannungen im Anschluss an das vorläufige Handelsabkommen zwischen den USA und China hinter sich ließen, gaben sie einher mit den Märkten weltweit nach, da die Auswirkungen der COVID-19-Pandemie sichtbar wurden. China verbuchte solide Gewinne, unterstützt durch staatliche Unterstützung und Erleichterung, dass das Land die Pandemie relativ früh überstanden hatte. Auch Japan schloss höher aufgrund von Anzeichen, dass das Land vergleichsweise abgeschirmt von der Gesundheitskrise geblieben war. Australische Aktien fielen jedoch als Buschbrände, schwächere Rohstoffpreise und eine relativ zinsbullische Haltung seitens der Zentralbank die Stimmung belastete.

Schwellenländeraktien („EM-Aktien“) beendeten den Berichtszeitraum etwas niedriger und lieferten eine Underperformance gegenüber den globalen Aktienmärkten. Obwohl die Sorgen um die Auswirkungen zunehmender Handelsspannungen Ende 2019 nachließen und exportorientierten Schwellenländern Unterstützung boten, wurden EM-Aktien durch die geringere Anlegernachfrage nach risikoreicheren Anlagen infolge der Ausbreitung von COVID-19 belastet. Fernöstliche Märkte schnitten unterstützt durch Chinas Konjunkturaneize und Erleichterung, nachdem die Region die Pandemie ziemlich früh überstanden hatte, relativ gut ab. Lateinamerikanische Märkte brachen infolge der unter COVID-19 leidenden Region ein, und Rohstoffpreise fielen aufgrund von Nachfragebefürchtungen. Auch die osteuropäischen Märkte hatten zu kämpfen, da einbrechende Energiepreise und Sorgen um die Regierung russische bzw. polnische Aktien belasteten.

## Fondsbericht (Fortsetzung)

### Marktkommentar – Juni 2020 (Fortsetzung)

#### Aktien (Fortsetzung)

IT-Aktien erzielten eine kräftige Performance und übertrafen die bescheidenen Zugewinne bei globalen Aktien locker. Beeindruckende Ergebnisse von führenden Hardware- und Software-Aktien trugen dazu bei, dass der Sektor im zweiten Halbjahr 2019 eine Outperformance verbuchte. Nach einem kurzfristigen Rücksetzer einher mit anderen globalen Märkten als Reaktion auf die COVID-19-Pandemie setzten IT-Aktien ihre Outperformance im zweiten Quartal anhand von Zuversicht in die Fähigkeit führender IT-Unternehmen, weiterhin attraktive Gewinne zu erzielen, fort. Die Mikrochiphersteller Nvidia und AMD zählten zu den größten Gewinnern, beflügelt durch robuste Ergebnisse und eine kräftige Nachfrage nach neuen Produkten. Auch der Softwareriese Microsoft legte zu, wofür steigende Umsätze bei Cloud-Diensten und Software zur Erleichterung von Telearbeit maßgeblich waren.

Aktien aus dem Gesundheitssektor erzielten kräftige Renditen und übertrafen die mäßigen Gewinne auf globalen Märkten mit Abstand. Nachdem sie im zweiten Halbjahr 2019 angesichts Optimismus in Bezug auf das Potenzial neuer Produkt-Pipelines vieler Pharmaunternehmen besser als andere Aktien weltweit abschnitten, zeigte sich der Sektor während und nach dem Höhepunkt der COVID-19-Pandemie bemerkenswert robust. Führende Unternehmen bei der Entwicklung von Tests, Behandlung und Impfstoffen für den Coronavirus, u. a. Regeneron Pharmaceuticals und AstraZeneca, erlebten einen Anstieg ihrer Bewertungen. Robuste Geschäftszahlen und M&A-Aktivitäten belebten den Sektor zusätzlich, und andere Pharmaaktien wie AbbVie, Eli Lilly und Bristol-Myers Squibb erwirtschafteten beeindruckende Gewinne.

#### Anleihen

Anleihenmärkte entwickelten sich besser als Aktien, da die Finanzmärkte volatiler wurden, vor allem im Februar und März, als die weit verbreitete Risikoaversion unter Anlegern die Nachfrage nach als „sichere Häfen“ erachtete Anlagen befeuerte. Die Renditen auf Staatsanleihen fielen, da Anleger mit weiteren geldpolitischen Maßnahmen seitens der wichtigsten Zentralbanken rechneten, um die globale Wirtschaft gegen die Auswirkungen des Coronavirus zu wappnen. Die Renditen von auf Pfund Sterling lautenden Unternehmensanleihen waren relativ bescheiden im Vergleich zu britischen Staatsanleihen (Gilts), und angesichts der Aktienverkaufswelle im ersten Quartal erfolgte eine Ausweitung der Credit Spreads. Obwohl die Inflation im April auf unter 1 % fiel, ihr niedrigster Stand seit 2016, wurden indexgebundene Wertpapiere durch ihre relativ langen Laufzeiten in einem steigenden Markt und Sorgen beflügelt, dass die außergewöhnlichen Zentralbankmaßnahmen und das staatliche Ausgabenprogramm zum Schutz gegen die wirtschaftlichen Folgen durch COVID-19 die mittel- bis langfristige Inflation befeuern könnten.

Schwellenländeranleihen entwickelten sich schwächer als Staatsanleihen aus Industrieländern. Obwohl niedrigere Zinsen und ein Rückgang der Anleiherenditen auf den wichtigsten Märkten die Nachfrage nach höher rentierlichen Staatsanleihen beflügelten, erlebten die Märkte im ersten Quartal eine kräftige Verkaufswelle, die durch die Schwäche lokaler Währungen gegenüber dem US-Dollar verstärkt wurde. Trotzdem waren die Emissionsniveaus hoch, da sowohl staatliche Emittenten als auch Unternehmen versuchten, internationale Investoren anzuziehen. Mehrere Schwellenländer mit relativ hohen Schulden und Leistungsbilanzdefiziten wurden allerdings zunehmend unter die Lupe genommen, vor allem die Türkei und Argentinien, wobei eine Rating-Herabstufung für Südafrika das verbleibende Kreditrisiko hervorhob.

September 2020

## Bericht des Verwaltungsrats

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

### Einleitung

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

### Beschreibung der Obliegenheiten des Verwaltungsrats

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

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

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

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

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



## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Beschreibung der Obliegenheiten des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

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

Der vom britischen Financial Reporting Council im Juli 2018 herausgegebene britische Corporate Governance Code (der „UK-Code“) und der Companies Act verlangen vom Verwaltungsrat ferner, sicherzustellen, dass der Jahresbericht und der Jahresabschluss in ihrer Gesamtheit fair, ausgewogen und verständlich sind und die nötigen Informationen zur Verfügung stellen, um die Ergebnisentwicklung und die Strategie der Gesellschaft bewerten zu können. Um zu einer Aussage über diesen Sachverhalt zu gelangen, hat der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) den Prüfungsausschuss gebeten, mitzuteilen, ob der Jahresbericht und der Jahresabschluss diese Anforderungen seiner Auffassung nach erfüllen. Im Ergebnis ist der Verwaltungsrat zu dem Schluss gelangt, dass der Jahresbericht und der Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 in ihrer Gesamtheit fair, ausgewogen und verständlich sind und den Anteilinhabern die Informationen zur Verfügung stellen, um die Lage, die Ergebnisentwicklung, das Geschäftsmodell und die Strategie der Gesellschaft bewerten zu können.

### Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Gesellschaftssekretärs

Weder der Verwaltungsrat und der Gesellschaftssekretär noch ihre Familien hatten weder während des Geschäftsjahrs zum 30. Juni 2020 noch am Bilanzstichtag direkt oder indirekt Beteiligungen an von der Gesellschaft ausgegebenen Anteilen (30. Juni 2019: null).

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

Mark Weeks (Brite) (zurückgetreten am 31. März 2020)

Eimear Cowhey (Irin)<sup>(1)</sup>

Adrian Waters (Ire)<sup>(1)</sup>

Amy Ellison (Britin)

Feargal Dempsey (Ire) (ernannt am 14. Januar 2020)<sup>(1), (2)</sup>

Howie Li (Brite) (ernannt am 23. März 2020)

Patrizia Libotte (Irin) (ernannt am 23. Juni 2020)

David Fagan (Ire) (ernannt am 16. Juli 2020)<sup>(1)</sup>

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

<sup>(2)</sup> Vorsitzender

Alle Verwaltungsratsmitglieder waren nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder.

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

### Transaktionen unter Beteiligung von Verwaltungsratsmitgliedern

Dem Verwaltungsrat sind keine wesentlichen Verträge oder Vereinbarungen im Zusammenhang mit dem Geschäft der Gesellschaft bekannt, an denen die Verwaltungsratsmitglieder zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahrs zum 30. Juni 2020 beteiligt gewesen wären wie im Companies Act definiert (30. Juni 2019: keine) mit Ausnahme der in Anmerkung 8, Wesentliche Vereinbarungen und Transaktionen mit verbundenen Parteien, offen gelegten.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Nach Section 225 des Companies Act geforderte Compliance-Erklärung des Verwaltungsrats

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

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

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

Die Erklärung zur Compliance-Politik sowie die Compliance-Vorkehrungen werden einer jährlichen Überprüfung unterzogen, um festzustellen, ob sie weiterhin angemessen gewährleisten, dass die Gesellschaft ihre maßgeblichen Verpflichtungen in jeder wesentlichen Hinsicht erfüllt. Eine solche Überprüfung erfolgte im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020.

### Corporate-Governance-Erklärung

#### A. Allgemeine Anforderungen

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

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

- I. dem irischen Companies Act 2014 (der „Companies Act“), der auf der Website des Irish Statute Book abrufbar ist: <http://www.irishstatutebook.ie>;
- II. der Satzung der Gesellschaft (die „Satzung“), die zur Einsichtnahme am eingetragenen Sitz der Gesellschaft sowie am eingetragenen Sitz des Verwalters sowie bei der Handelsregisterbehörde (Companies Registration Office) in Irland zur Verfügung steht;
- III. den OGAW-Vorschriften der Zentralbank, die derzeit auf der Website der Central Bank of Ireland unter <https://www.centralbank.ie/regulation/industry-market-sectors/funds/ucits> abrufbar sind;

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### A. Allgemeine Anforderungen (Fortsetzung)

- IV. dem britischen, vom Financial Reporting Council im Juli 2018 herausgegebenen Corporate Governance Code (der „UK-Code“), der zur Verfügung steht unter: <https://www.frc.org.uk/Our-Work/Codes-Standards/Corporate-governance/UK-Corporate-Governance-Code.aspx>; und
- V. den Börsenzulassungsregeln der United Kingdom Listing Authority (die UKLA-Börsenzulassungsregeln), insoweit sie für ausländische Investmentfonds gemäß Kapitel 16 der UKLA-Börsenzulassungsregeln sowie den maßgeblichen Kapiteln der Offenlegungsregeln und der Transparenzregeln (Disclosure Rules and Transparency Rules) der Financial Conduct Authority („FCA“) gelten, die nachzulesen sind auf: <http://fshandbook.info/FS/html/handbook/DTR>.

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

Als Emittent von börsengehandelten Indexfonds (ETFs) hat die Gesellschaft die Struktur eines Umbrellafonds und setzt sich zusammen aus einer Reihe von separaten Fonds mit getrennter Haftung zwischen den einzelnen Fonds. Das alleinige Ziel der Gesellschaft besteht in der gemeinsamen Anlage von auf dem Kapitalmarkt aufbrachten Geldern gemäß den speziellen Anlagezielen/Anlagestrategien der einzelnen Fonds, die vom Verwaltungsrat zum Zeitpunkt der Auflegung der einzelnen Fonds festgelegt und im Verkaufsprospekt der Gesellschaft und den fondsspezifischen Nachträgen dazu dargelegt werden. Die Anteile der einzelnen Fonds und jede ihrer Anteilklassen, sofern sie aus mehr als einer Anteilklasse bestehen, werden zu verschiedenen Bedingungen ausgegeben. Jede Änderung am Anlageziel eines Fonds und/oder jede wesentliche Änderung der Anlagestrategie eines Fonds bedarf der vorherigen Zustimmung der Anteilinhaber der verschiedenen Anteilklassen des betreffenden Fonds. Die Gesellschaft unterliegt nicht den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (betreffend Übernahmeangebote (Richtlinie 2004/25/EG)) von 2006.

Bestimmte Fonds der Gesellschaft haben eine Vorzugsnotierung am Hauptmarkt der London Stock Exchange, und daher findet der UK-Code Anwendung. Unter Einhaltung des im UK-Code vorgesehenen „Comply-or-Explain“-Ansatzes wendet die Gesellschaft die wesentlichen Grundsätze des UK-Code an, insofern der Verwaltungsrat der Gesellschaft diese als relevant und angemessen für eine offene Investmentgesellschaft erachtet, die börsengehandelte Indexfonds auflegt. Entsprechend liefert der Verwaltungsrat der Gesellschaft eine Erklärung, wenn er bestimmte Aspekte im UK-Code nicht für relevant hält. Im Berichtsjahr entsprachen die Corporate-Governance-Praktiken der Gesellschaft generell den wesentlichen Grundsätzen des UK-Code.

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### A. Allgemeine Anforderungen (Fortsetzung)

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

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

**Jedes Verwaltungsratsmitglied, dessen Name und Funktion auf den Seiten 20 bis 22 in diesem Jahresbericht aufgeführt ist, bestätigt, dass nach bestem Wissen und Gewissen der einzelnen Personen:**

- der gemäß den EU-IFRS aufgestellte Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und Finanzlage der Gesellschaft zum 30. Juni 2020 und des Anstiegs des Nettovermögens, das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile für das dann beendete Geschäftsjahr zuzurechnen ist, vermittelt;
- der im Jahresbericht enthaltene Bericht des Verwaltungsrats (Lagebericht) eine zutreffende Darstellung der Geschäfts- und Ertragsentwicklung sowie der Lage der Gesellschaft zusammen mit einer Beschreibung der wichtigsten Risiken und Ungewissheiten, denen sie ausgesetzt ist, enthält; und
- der Jahresbericht und der Jahresabschluss in ihrer Gesamtheit fair, ausgewogen und verständlich sind und den Anteilinhabern die Informationen zur Verfügung stellen, um die Lage, die Ergebnisentwicklung, das Geschäftsmodell und die Strategie der Gesellschaft bewerten zu können.

#### C. Verwaltungsrat

##### 1. Zusammensetzung des Verwaltungsrats

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

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

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

- Eimear Cowhey (irische Staatsangehörigkeit, Wohnsitz in Irland) – unabhängiges nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied, Mitglied des Prüfungsausschusses – am 23. Juni 2011 in den Verwaltungsrat berufen

Frau Cowhey (Wohnsitz in Irland) hat über 30 Jahre Erfahrung in der Offshore-Fondsbranche und ist derzeit als nicht-geschäftsführende(s) unabhängige(s) Vorsitzende, Verwaltungsratsmitglied und Ausschussmitglied verschiedener Investmentfonds, Anlageverwaltungs- und MiFID-Gesellschaften in Irland, England und Luxemburg tätig. Von 1999 bis 2006 hatte sie verschiedene leitende Führungs- und Verwaltungsratspositionen bei der Pioneer Amundi Group inne, unter anderem als Head of Legal and Compliance und Head of Product Development. Von 1992 bis 1999 bekleidete sie verschiedene leitende Führungs- und Verwaltungsratspositionen bei Invesco Asset Management, unter anderem als Managing Director, Global Fund Director und Head Legal Counsel. Frau Cowhey ist irische Juristin mit einem Diplom in Rechnungs- und Finanzwesen (ACCA), einem Diplom in Unternehmensleitung (IoD) und einem Abschluss in Finanzdienstleistungsrecht (UCD) und erwirbt gerade den Status Chartered Director am IoD (London).

Frau Cowhey war Mitglied des Committee on Collective Investment Governance (CCIG), das von der Zentralbank im Dezember 2013 eingerichtet wurde und im Juli 2014 einen Expertenbericht über Empfehlungen für gute Governance-Praktiken für Investmentfonds herausgab.

Frau Cowhey ist ehemalige Vorsitzende und ehemaliges Ausschussmitglied von Irish Funds und ein ehemaliges Mitglied der IFSC Funds Group, ein Verbund von Regierung und Investmentbranche, der die Regierung in Fragen zu Investmentfonds berät. Sie ist Gründerin und Verwaltungsratsmitglied von basis.point, der gemeinnützigen Organisation der Investmentfondsbranche, die Bildungsprogramme für benachteiligte Kinder fördert.

- Adrian Waters (irische Staatsangehörigkeit, Wohnsitz in Irland) – unabhängiges nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied, Vorsitzender des Prüfungsausschusses – am 23. Juni 2011 in den Verwaltungsrat berufen

Herr Waters (Ire) mit Wohnsitz in Irland ist Mitglied des Institute of Chartered Accountants in Ireland und des Institute of Directors. Er hat den Status eines Chartered Director (UK Institute of Directors) und spezialisiert sich auf Risikomanagement und Governance. Er hat mehr als 30 Jahre Berufserfahrung in der Fondsbranche. Er ist ein Director verschiedener anderer Investmentfonds. Von 1993 bis 2001 hatte er verschiedene Führungspositionen bei der BISYS Group, Inc. (nun Teil der Citi Group) inne, unter anderem war er als Chief Executive Officer von BISYS Fund Services (Ireland) Limited und zum Schluss aus London als Senior Vice President – Europe für BISYS Investment Services tätig. Von 1989 bis 1993 arbeitete er für die Investment Services Group von PricewaterhouseCoopers in New York und davor für die Wirtschaftsprüfungsgesellschaft (Chartered Accountants) Oliver Freaney and Company in Dublin. Herr Waters hat einen Bachelor of Commerce und ein Post Graduate Diploma in Corporate Governance des University College Dublin, die er 1985 bzw. 2005 erhielt. Zusätzlich erhielt er in 2013 einen Master of Science in Risikomanagement von der Stern Business School an der New York University.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

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

- Mark Weeks (britische Staatsangehörigkeit, Wohnsitz im Vereinigten Königreich) – Vorsitzender seit 15. September 2016, nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied – am 15. Oktober 2009 in den Verwaltungsrat berufen bzw. am 31. März 2020 zurückgetreten.

Herr Weeks ist ein nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft und des Unternehmens. Er war zuvor Chief Executive Officer von ETF Securities (UK) Limited. Von 2006 bis 2009 war er bei der UBS, wo er das Wertpapierleihgeschäft in Zürich leitete. Davor war er 7 Jahre bei Goldman Sachs International tätig, wo er als Managing Director verantwortlich für Vertrieb und Trading im Bereich European Securities Finance war und institutionelle Großkunden und Hedge-Fonds-Kunden betreute. Von 1993 bis 1999 war Herr Weeks Global Head of Securities Finance Sales bei London Global Securities. Er war ferner bei IP Sharp im Verkauf von Securities-Finance-Systemen tätig und bei Morgan Stanley verantwortlich für Vertrieb und Trading im Bereich European Securities Finance.

- Amy Ellison (britische Staatsangehörigkeit, Wohnsitz im Vereinigten Königreich) – nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied – am 29. März 2019 in den Verwaltungsrat berufen

**Frau Ellison ist ein nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft und der Gesellschaft.** Frau Ellison ist Chartered Accountant mit mehr als 19 Jahren Erfahrung in den Bereichen Prüfung und Finanzen, die sie durch ihre Tätigkeit bei führenden Versicherungen und Finanzdienstleistungsunternehmen erworben hat. Im Jahr 2001 stieß sie als Trainee zu PricewaterhouseCoopers LLP („PwC“) und bekleidete im Anschluss eine Reihe von Führungspositionen, darunter die des Director/Responsible Individual mit Schwerpunkt Erbringung externer Prüfungsleistungen für den Versicherungssektor. Sie war im Vereinigten Königreich und in Australien tätig und verantwortlich für die Erbringung von Prüfungs- und Bestätigungsleistungen für globale börsennotierte Versicherungs- und Vermögensverwaltungsmandanten. Nach dem Wechsel zum Head of Audit der Konzernrevisionsfunktion von Legal & General im Jahr 2016 war Frau Ellison für die Durchführung sämtlicher Innenrevisionsaktivitäten für die Geschäftsbereiche Insurance, General Insurance, Mature Savings und Capital Investment verantwortlich.

Im Jahr 2018 war Frau Ellison acht Monate lang bei der britischen Regierung im Ressort für Wirtschaft, Energie und Industriestrategie eingesetzt und bekleidete dort die Position des Policy Lead für die unabhängige Überprüfung des Financial Reporting Council in Zusammenarbeit mit Sir John Kingman, dem Vorsitzenden der Legal & General Group. Nach ihrer Rückkehr zur Legal & General Group im Januar 2019 stieß Frau Ellison zum Team von LGIM Finance und bekleidet dort die Position des Finance Director der Bereiche Defined Contribution und Retail (einschließlich Personal Investing).

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

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

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

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

Herr Li hat über 15 Jahre Erfahrung in der Vermögensverwaltungsbranche und ist leitender Angestellter der Legal & General Investment Management Limited. Herr Li kam zur Legal & General Investment Management Limited nach der erfolgreichen Übernahme von ETF Securities im Jahr 2018. Herr Li ist als Head of ETFs bei der Legal & General Investment Management Limited tätig und verantwortlich für die Leitung der Entwicklung und des Wachstums des ETF-Geschäfts. Bevor er zur Legal & General Investment Management Limited wechselte, hatte Herr Li mehrere führende Positionen bei ETF Securities inne, u. a. Head of Legal, Co-Head und CEO. Herr Li begann seine Karriere bei Simmons & Simmons LLP als Anwalt für Finanzdienstleistungsrecht.

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

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 2. Unabhängigkeit der Verwaltungsratsmitglieder

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

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

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

Gemäß dem UK-Code hat der Verwaltungsrat die Unabhängigkeit von Frau Cowhey, Herrn Waters und Herrn Dempsey geprüft und entschieden, dass sie als unabhängige Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft erachtet werden, da sie als in ihrer Urteilsfähigkeit unabhängig befunden wurden und diesbezüglich keine Beziehungen oder Umstände vorliegen, welche die Urteilsfähigkeit dieser Verwaltungsratsmitglieder beeinträchtigen können.

Während Herr Weeks aufgrund der Tatsache, dass er der CEO der ETF Securities (UK) Limited war und bis zum 14. Januar 2020 ein nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied und Vorsitzender der Verwaltungsgesellschaft blieb, kein unabhängiges Verwaltungsratsmitglied ist, hat er seine Fähigkeit bewiesen, objektive Entscheidungen zu treffen. Der Verwaltungsrat ist der Auffassung, dass Herr Weeks den Verwaltungsrat gut geleitet und sichergestellt hat, dass kritische Gespräche stattfinden und Dritte effektiv und ordnungsgemäß hinterfragt wurden. Herr Weeks hat während seiner Amtszeit als Vorsitzender ferner stets eine effektive Kommunikation zwischen den Verwaltungsratsmitgliedern gefördert.

Der UK-Code sieht vor, dass der Vorsitzende bei seiner Ernennung die Unabhängigkeitskriterien des UK Code erfüllen sollte. Umgekehrt schreibt der IF-Code nicht vor, dass der Vorsitzende vor oder nach seiner Bestellung unabhängig sein muss. Wie oben erwähnt, wurde der IF-Code jedoch speziell auf offene Investmentgesellschaften in Irland zugeschnitten, weshalb der Verwaltungsrat die Auffassung vertritt, dass die Zusammensetzung des Verwaltungsrats im Berichtszeitraum in Bezug auf die Unabhängigkeit der Urteilsfähigkeit ausgewogen genug war und den Branchenerwartungen entsprach.

##### 3. Unterstützung für Verwaltungsratsmitglieder

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

##### 4. Versicherung

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



## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 5. Bestellung

Der Verwaltungsrat ist verantwortlich für die Überprüfung der Größe, Struktur und Zusammensetzung des Verwaltungsrats und für die Erwägung von Änderungen oder Neubestellungen. Aufgrund der Größe des Verwaltungsrats hat der Verwaltungsrat keinen Nominierungsausschuss eingerichtet, weil die Aufgabe der Prüfung von Kandidaten zur Besetzung frei gewordener Sitze im Verwaltungsrat vom Verwaltungsrat in seiner Gesamtheit ausgeübt wird. Der Verwaltungsrat kann einen externen Personalberater mit der Suche nach potenziellen Kandidaten beauftragen. Bislang ist der Verwaltungsrat jedoch selbst in der Lage gewesen, die geeignetsten Kandidaten für die Aufnahme im Verwaltungsrat durch seinen eigenen Auswahlprozess zu ermitteln, und hat deshalb noch keinen Bedarf für die Beauftragung eines externen Personalberaters gesehen. Im Rahmen des mit der generellen Überprüfung potenzieller Kandidaten verbundenen Due-Diligence-Verfahrens holt der Verwaltungsrat Empfehlungen und Referenzen von externen Dienstleistern und Beratern der Gesellschaft ein, bevor eine Bestellung erfolgt. Bestellungen in den Verwaltungsrat unterliegen ferner der Genehmigung der Central Bank of Ireland.

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

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

##### 6. Leistungsevaluierung

Die Leistung eines jeden Verwaltungsratsmitglieds, des Verwaltungsratsvorsitzenden und des Verwaltungsrats in seiner Gesamtheit wurde mittels eines förmlichen jährlichen Evaluierungsprozesses in Bezug auf das Kalenderjahr 2019 bewertet.

Auch die Leistung des Prüfungsausschusses wurde für das Kalenderjahr 2019 einer förmlichen jährlichen Überprüfung unterzogen.

In Bezug auf die Evaluierung des Verwaltungsrats in seiner Gesamtheit haben alle Mitglieder des Verwaltungsrats einen Fragebogen auszufüllen, der an den Vorsitzenden zurückgeschickt wird. Der Vorsitzende ist dafür verantwortlich, die Antworten der Fragebögen zusammenzustellen und dem übrigen Verwaltungsrat zu präsentieren. In dieser Präsentation sind die Einschätzungen und Meinungen, die in den Fragebögen zum Ausdruck gebracht wurden, und die ersten Ergebnisse der Evaluierung darzulegen. Die Ergebnisse der Fragebögen und die ersten Ergebnisse der Evaluierung werden in einer offenen Gesprächsrunde diskutiert. Ebenso diskutiert wird die Leistung des Verwaltungsrats in seiner Gesamtheit. Die Verwaltungsratsmitglieder werden dazu ermutigt, weitere Themen, die nicht bereits in den ersten Ergebnissen offensichtlich wurden, anzusprechen und Vorschläge für Änderungen oder Verbesserungen zu unterbreiten.

Im Hinblick auf die Evaluierung eines jeden einzelnen Verwaltungsratsmitglieds erstellt der Vorsitzende eine erste Überprüfung eines jeden Verwaltungsratsmitglieds und bespricht (ggf.) die jeweilige Leistung mit dem einzelnen Verwaltungsratsmitglied. Anschließend präsentiert der Vorsitzende seine Ergebnisse dem Verwaltungsrat, die dann in einer offenen Gesprächsrunde diskutiert werden. Die Verwaltungsratsmitglieder werden dazu ermutigt, weitere Themen, die nicht bereits in den ersten Ergebnissen offensichtlich wurden, anzusprechen und Vorschläge für Änderungen oder Verbesserungen zu unterbreiten.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 6. Leistungsevaluierung (Fortsetzung)

Im Hinblick auf die Evaluierung eines jeden einzelnen Verwaltungsratsmitglieds erstellt der Vorsitzende eine erste Überprüfung eines jeden Verwaltungsratsmitglieds und bespricht (ggf.) die jeweilige Leistung mit dem einzelnen Verwaltungsratsmitglied. Anschließend präsentiert der Vorsitzende seine Ergebnisse dem Verwaltungsrat, die dann in einer offenen Gesprächsrunde diskutiert werden. Die Verwaltungsratsmitglieder werden dazu ermutigt, weitere Themen, die nicht bereits in den ersten Ergebnissen offensichtlich wurden, anzusprechen und Vorschläge für Änderungen oder Verbesserungen zu unterbreiten.

Im Hinblick auf die Evaluierung des Vorsitzenden wird ein jedes der unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder eine erste Überprüfung des Vorsitzenden erstellen und dessen Leistung ggf. mit ihm besprechen. Anschließend präsentieren die unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder dem Verwaltungsrat ihre Ergebnisse, die dann in einer offenen Gesprächsrunde diskutiert werden. Die Verwaltungsratsmitglieder werden dazu ermutigt, weitere Themen, die nicht bereits in den ersten Ergebnissen offensichtlich wurden, anzusprechen und Vorschläge für Änderungen oder Verbesserungen zu unterbreiten.

Im Hinblick auf die Bewertung des Prüfungsausschusses muss jedes Mitglied des Prüfungsausschusses einen Bewertungsfragebogen ausfüllen. Anschließend präsentiert der Vorsitzende des Prüfungsausschusses die Ergebnisse dem übrigen Verwaltungsrat, die dann in einer offenen Gesprächsrunde diskutiert werden. Die Verwaltungsratsmitglieder werden dazu ermutigt, weitere Themen, die nicht bereits in den ersten Ergebnissen offensichtlich wurden, anzusprechen und Vorschläge für Änderungen oder Verbesserungen zu unterbreiten.

##### 7. Wiederwahl und Amtszeit

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

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

Anwesenheitsliste für Verwaltungsratssitzungen im Geschäftsjahr:

Verwaltungsratsmitglied	22. August 2019	18. Oktober 2019	14. Januar 2020	14. Februar 2020	11. Mai 2020
Mark Weeks*	J	J	N	N	Nicht zutreffend
Adrian Waters	J	J	J	J	J
Eimear Cowhey	J	J	J	J	J
Amy Ellison	J	N	J	J	N
Feargal Dempsey**	Nicht zutreffend	Nicht zutreffend	J	J	J
Howie Li***	Nicht zutreffend	Nicht zutreffend	Nicht zutreffend	Nicht zutreffend	J
Patrizia Libotte****	Nicht zutreffend	Nicht zutreffend	Nicht zutreffend	Nicht zutreffend	Nicht zutreffend

\* Als Verwaltungsratsmitglied mit Wirkung vom 31. März 2020 zurückgetreten.

\*\* Ernennung zum Verwaltungsratsmitglied mit Wirkung vom 14. Januar 2020.

\*\*\* Ernennung zum Verwaltungsratsmitglied mit Wirkung vom 23. März 2020.

\*\*\*\* Ernennung zum Verwaltungsratsmitglied mit Wirkung vom 23. Juni 2020.

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### C. Verwaltungsrat (Fortsetzung)

##### 10. Ausschüsse des Verwaltungsrats

###### Prüfungsausschuss

Im März 2014 richtete die Gesellschaft einen Prüfungsausschuss ein, der sich aus den zwei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern, Eimear Cowhey und Adrian Waters, zusammensetzt (der „Prüfungsausschuss“). Adrian Waters ist Vorsitzender des Prüfungsausschusses. Weitere Informationen über den Aufgabenumfang des Prüfungsausschusses sind im Abschnitt „Prüfungsausschuss“ im nachstehenden Abschnitt D enthalten.

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

##### 11. Vergütung von Verwaltungsratsmitgliedern

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

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

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

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

##### 12. Bericht über Mitgliedschaft und Diversität im Verwaltungsrat

Der Verwaltungsrat erkennt die Bedeutung an, die der Diversität für operative Verbesserungen zukommt. Im Auswahlverfahren ist der Verwaltungsrat verpflichtet, auf Diversität bezüglich Alter, Geschlecht, Ausbildung und beruflichem Hintergrund zu achten. Zur Bestellung werden Kandidaten auf der Grundlage dieser Attribute ausgewählt. Der Verwaltungsrat stellt sicher, dass sämtliche Auswahlentscheidungen auf der Leistung basieren und die Einstellung gerecht und nicht diskriminierend erfolgt. Nach Überzeugung des Verwaltungsrats ist eine Vielfalt an Erfahrungen und Ansätzen, einschließlich Ausbildung und beruflichem Hintergrund, Geschlecht und Alter, unter den Verwaltungsratsmitgliedern von großem Wert bei der Berücksichtigung der allgemeinen Ausgewogenheit bei Entscheidungen über die Ernennung neuer Verwaltungsratsmitglieder. Für den Verwaltungsrat hat Priorität, dass er weiterhin führungsstark ist und über die einschlägigen Kompetenzen verfügt, um die Geschäftsstrategie umzusetzen. Der Verwaltungsrat hat sich für Geschlechterdiversität keine konkreten Ziele gesetzt, erkennt jedoch ihre Bedeutung an. Derzeit sind Frauen mit einem Anteil von 50 % vertreten.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

#### D. Risikomanagement und interne Kontrolle

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

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

##### Delegierung an die Verwaltungsgesellschaft

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

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

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

##### Funktionen, die dem Verwaltungsrat der Gesellschaft vorbehalten bleiben

Ungeachtet der Bestellung der Verwaltungsgesellschaft behält sich der Verwaltungsrat der Gesellschaft die funktionalen Aspekte der Überwachung und Überprüfung der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme der Bevollmächtigten im Finanzberichterstattungskontext vor. Zu diesem Zweck wurde eigens ein Prüfungsausschuss eingerichtet, der sich aus zwei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft zusammensetzt. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Abschnitt 2 „Der Überwachungsrahmen der Gesellschaft für die Risikokontrolle im Hinblick auf die Finanzberichterstattung“ und dem Bericht des Prüfungsausschusses auf den Seiten 53 bis 56.

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

- die Auflegung und Auflösung von Fonds und deren Anteilklassen;
- die Festlegung der Anlageziele und der Anlagestrategien der Fonds;
- die Festlegung der „Gesamtkostenquote“ für die einzelnen Fonds und ihre Anteilklassen;

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

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

- grenzüberschreitende Registrierungen der Fonds;
- Börsennotierungen
- die Bestellung des Gesellschaftssekretärs, der Verwahrstelle und des Abschlussprüfers;
- der Abschluss und die Kündigung wesentlicher Verträge und
- die Genehmigung der Verkaufsprospekte, Rundschreiben an die Anteilinhaber und anderer rechtlich relevanter Dokumente.

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

##### **Gemeinsamer Verwaltungsrat**

Ungeachtet der allgemeine Delegation durch die Gesellschaft an die Verwaltungsgesellschaft ist der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft (der „Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft“) mit dem Verwaltungsrat der Gesellschaft identisch. Dementsprechend finden die quartalsmäßigen Verwaltungsratssitzungen für die Gesellschaft und die Verwaltungsgesellschaft gleichzeitig statt. Die jeweiligen Verwaltungsratsmitglieder erörtern die verschiedenen ihnen eigens übertragenen (im Falle der Verwaltungsgesellschaft) bzw. ihnen vorbehaltenen (im Falle der Gesellschaft) Angelegenheiten. Maßgebliche Angelegenheiten, die vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft erörtert werden, gelten auch als vom Verwaltungsrat der Gesellschaft zur Kenntnis genommen und erörtert. Diesbezüglich vergewissert sich der Verwaltungsrat der Gesellschaft kontinuierlich, dass er eine wirksame Aufsicht über die funktionale Rolle der Verwaltungsgesellschaft hinsichtlich der Überwachung und Überprüfung der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme der verschiedenen Bevollmächtigten durch die Verwaltungsgesellschaft ausübt. Der Verwaltungsrat der Gesellschaft behält es sich vor, der Verwaltungsgesellschaft bei Bedarf selbst Richtlinien und/oder Anweisungen im Zusammenhang mit der Ausübung des Geschäfts der Gesellschaft vorzugeben bzw. zu erteilen.

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

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

Die Gesellschaft hat Ernst & Young mit Wirkung vom 1. April 2020 als Abschlussprüfer der Gesellschaft für das zu prüfende Geschäftsjahr bestellt.

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

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

#### Prüfungsausschuss

Gemäß Section 167 des Companies Act und entsprechend dem UK-Code richtete die Gesellschaft im März 2014 einen Prüfungsausschuss ein, der sich aus den zwei unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern, Adrian Waters und Eimear Cowhey (zusammen der „Prüfungsausschuss“) zusammensetzt. Adrian Waters ist Vorsitzender des Prüfungsausschusses. Dessen Bericht in Bezug auf das Geschäftsjahr ist im „Bericht des Prüfungsausschusses“ auf den Seite 53 bis 56 zu finden.

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

- Überwachung der Integrität der Rechnungsabschlüsse der Gesellschaft sowie sämtlicher formeller Bekanntgaben bezüglich der finanziellen Performance der Gesellschaft und Überprüfung der wesentlichen in der Finanzberichterstattung enthaltenen Beurteilungen und Bericht an den Verwaltungsrat darüber, ob der Abschluss in seiner Gesamtheit einen fairen, ausgewogenen und verständlichen Überblick über die Ergebnisentwicklung, das Geschäftsmodell und die Strategie der Gesellschaft vermittelt;

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

###### Prüfungsausschuss (Fortsetzung)

- Prüfung und Beurteilung der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme der Gesellschaft im Zusammenhang mit der Finanzberichterstattung, einschließlich der Verfahren der Gesellschaft zur Vermeidung und Aufdeckung von Betrug;
- Überwachung und Prüfung der Wirksamkeit des Vertrauens der Gesellschaft auf die Innenrevisionsfunktionen der Bevollmächtigten;
- Empfehlungen an den Verwaltungsrat im Zusammenhang mit der Bestellung, Wiederbestellung und Abberufung der Abschlussprüfer und der Vergütung und Konditionen für die Beauftragung der Abschlussprüfer;
- Überprüfung und Überwachung der Unabhängigkeit und Objektivität der Abschlussprüfer sowie der Effektivität des Prüfungsprozesses unter Berücksichtigung der maßgeblichen rechtlichen und regulatorischen Anforderungen;
- Besprechung mit den Abschlussprüfern zu deren allgemeinem Ansatz sowie Art und Umfang ihrer Prüfung und Berichtspflichten sowie Sicherstellung, dass es keine offenen Fragen oder Bedenken gibt;
- Entwicklung und Implementierung von Richtlinien zur Beauftragung der Abschlussprüfer mit prüfungsfremden Dienstleistungen unter Berücksichtigung der maßgeblichen ethischen Richtlinien für die Erbringung von prüfungsfremden Dienstleistungen durch die externe Wirtschaftsprüfungsgesellschaft; und
- Berichterstattung an den Verwaltungsrat darüber, wie er seine Aufgaben wahrgenommen hat, Benennung aller Angelegenheiten, für die nach Erachten des Ausschusses Handlungs- oder Verbesserungsbedarf besteht, mit Empfehlung der entsprechenden Schritte.

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

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

Sitzungen des Prüfungsausschusses sind mindestens drei Mal jährlich abzuhalten und fallen gegebenenfalls mit wichtigen Terminen im Berichterstattungszyklus der Gesellschaft zusammen, um den Plan, Zeitplan und Umfang der Prüfung zusammen mit den externen Abschlussprüfern festzulegen, zur Überprüfung der internen Finanzkontrollen, des Entwurfs der Jahres- und Halbjahresabschlüsse und der Bilanzierungsgrundsätze der Gesellschaft. Der Prüfungsausschuss führt eine Überprüfung des Inhalts des Jahresberichts in der Absicht durch, den Verwaltungsrat zu beraten, ob dieser fair, ausgewogen und verständlich ist und Anteilinhabern die Informationen liefert, die notwendig sind, um die Ergebnisentwicklung und Geschäftsstrategie der Gesellschaft bewerten zu können.



## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

###### Prüfungsausschuss (Fortsetzung)

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

Die Mitgliedschaft des Prüfungsausschusses ist vom Verwaltungsrat jährlich zu überprüfen.

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

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

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

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

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

###### *Anlageverwalter*

GO ETF Solutions LLP ist von der Verwaltungsgesellschaft als Anlageverwalter für die einzelnen Fonds bestellt worden, womit diese für das Management der Anlage der Vermögenswerte der Fonds verantwortlich ist und dabei grundsätzlich der Überwachung und Leitung durch die Verwaltungsgesellschaft unterliegt. Der Anlageverwalter übt seine Tätigkeit gemäß den vom Verwaltungsrat der Gesellschaft festgelegten Anlagezielen und -strategien und wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft und in den verschiedenen fondsspezifischen Nachträgen dazu beschrieben aus. Der Anlageverwalter ist unmittelbar verantwortlich für die Entscheidungen über das Tagesgeschäft der Fonds und dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft gegenüber rechenschaftspflichtig für die Anlageperformance der Fonds. Die Verwaltungsgesellschaft hat auch das tägliche Management der mit den Anlagen der Fonds verbundenen Risiken auf den Anlageverwalter übertragen. Der Anlageverwalter gewährleistet, dass es einen angemessenen Risikomanagementprozess für die Gesellschaft und ihre Fonds gibt, und dass dessen Funktionsweise hinreichend ist.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

###### *Anlageverwalter (Fortsetzung)*

Der Anlageverwalter kann mit der Zustimmung der Verwaltungsgesellschaft und vorbehaltlich der Genehmigung seitens der Central Bank of Ireland falls erforderlich Aufgaben an Unteranlageverwalter/Berater oder andere Bevollmächtigte delegieren. Einzelheiten zu diesen ggf. bestellten Unternehmen werden Anteilhabern auf Anfrage zur Verfügung gestellt und in den Jahres- und Halbjahresberichten der Gesellschaft veröffentlicht.

Der Anlageverwalter hat seinen Sitz im Vereinigten Königreich, ist von der britischen Financial Conduct Authority (die „FCA“) zugelassen und untersteht deren Aufsicht und gehört zur Unternehmensgruppe von L&G.

###### *Unteranlageverwalter*

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

Der Anlageverwalter hat an Lombard Odier Asset Management (Europe) Limited auf diskretionärer Basis alle Befugnisse, Pflichten und Ermessensfreiheiten delegiert, die in Bezug auf das Management und die Anlage der Vermögenswerte des L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF, L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF, L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF, L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF und L&G LOIM Euro Government Bond Fundamental UCITS ETF (die „L&G LOIM Funds“) auszuüben sind, einschließlich des täglichen Managements der mit den Anlagen verbundenen Risiken. Lombard Odier Asset Management (Europe) Limited hat ihren Sitz in England und ist von der britischen Financial Conduct Authority (die „FCA“) zugelassen und untersteht deren Aufsicht.

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

###### *Vertriebsstelle*

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

###### *Registerstelle*

Mit Wirkung zum 20. April 2020 wurde die Abrechnung des Handels mit Anteilen aller Fonds innerhalb der Gesellschaft in einer auf einer internationalen zentralen Wertpapierverwahrstelle (International Central Securities Depository; ICSD) basierenden Struktur zentralisiert. BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company wurde für die Fonds der Gesellschaft, die zum oben genannten Datum auf das ICSD-Modell umgestellt wurden, als Registerstelle beauftragt.

###### *Verwalter*

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

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

Der Verwalter ist von der Central Bank of Ireland gemäß dem Investment Intermediaries Act von 1995 zugelassen.

###### *Verwahrstelle*

Anders als die vorstehend beschriebenen Bevollmächtigten, die alle von der Verwaltungsgesellschaft bestellt wurden, hat die Gesellschaft The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch direkt als Verwahrstelle für ihre Vermögenswerte bestellt mit der doppelten Verantwortung, die Art und Weise zu überwachen, in der die Gesellschaft verwaltet wird, und die Vermögenswerte der Gesellschaft gemäß den OGAW-Vorschriften sicher zu verwahren. Die Verwahrstelle ist eine Gesellschaft mit beschränkter Haftung, die am 13. Oktober 1994 in Irland gegründet wurde. Die Hauptgeschäftstätigkeit der Verwahrstelle besteht in ihrer Aufgabe als Verwahrstelle und Treuhänder für die Vermögenswerte von Organismen für gemeinsame Anlagen.

Die Verwahrstelle ist von der Central Bank of Ireland gemäß dem Investment Intermediaries Act von 1995 zugelassen.

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

##### Überwachung und Überprüfung durch die Verwaltungsgesellschaft

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

Eine Zusammenfassung der wichtigsten Merkmale des Rahmens für die interne Kontrolle und das Risikomanagement erfolgt nachstehend:

##### Überwachung der Bevollmächtigten

Im März 2014 wurde Mark Weeks vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft zum designierten Verwaltungsratsmitglied für die Aufsicht über die Bevollmächtigten bestellt (das die „Bevollmächtigten überwachende Verwaltungsratsmitglied“) und ihm wurde die Verantwortung übertragen für den Vorsitz eines Ausschusses (aber nicht eines Ausschusses des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft oder des Verwaltungsrats der Gesellschaft), der sich aus seiner Person, dem leitenden Management des Anlageverwalters und der Vertriebsstelle („Überwachungsausschuss für Bevollmächtigte“) zusammensetzt.

Bis einschließlich 16. März 2018 wurde der Überwachungsausschuss für Bevollmächtigte vom die Bevollmächtigten überwachenden Verwaltungsratsmitglied geleitet. Er kam monatlich zusammen und bot ein Diskussionsforum in Bezug auf alle die Bevollmächtigten betreffenden Angelegenheiten und die von ihnen regelmäßig erhaltenen Berichte (siehe umseitig).

In Übereinstimmung mit der Central Bank of Ireland CP86 Fund Management Guidance (Leitlinien der irischen Zentralbank herausgegeben im Dezember 2016 und in Kraft getreten am 1. Juli 2018) wurde am 16. März 2018 die Funktion von Herrn Weeks vom die Bevollmächtigten überwachenden Verwaltungsratsmitglied in „designierter Verantwortlicher für die Managementfunktionen der aufsichtsrechtlichen Compliance, des Vertriebs und der Anlageverwaltung“ geändert. Die Bestellung von Herrn Weeks wurde vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft 16. März 2018 genehmigt.

Herr Weeks führt weiterhin den Vorsitz im Überwachungsausschuss für Bevollmächtigte, einem Ausschuss, der sich aus dem designierten Verantwortlichen für die Anlageverwaltung, den Vertrieb und die aufsichtsrechtliche Compliance und verschiedenen Mitarbeitern der L&G-Gruppe zusammensetzt, die im Namen der Muttergesellschaft, des Anlageverwalters und der Vertriebsstelle in Bezug auf die Dienstleistungen, die diese Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft erbringen, handeln (d.h. er ist kein Ausschuss des Verwaltungsrates selbst).

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

###### Überwachung der Bevollmächtigten (Fortsetzung)

Der Überwachungsausschuss für Bevollmächtigte tagt monatlich (oder öfter, falls erforderlich), um alle Fragen im Zusammenhang mit der Überwachung der Bevollmächtigten zu erörtern. Der Überwachungsausschuss für Bevollmächtigte überwacht den Lebenszyklus einer delegierten Vereinbarung (d.h. von der Phase der Delegationsentscheidung bis zur Phase nach Vertragsabschluss). Der Überwachungsausschuss für Bevollmächtigte überprüft die Wirksamkeit jeder delegierten Dienstleistung und berücksichtigt insbesondere die a) Beziehung, b) die Kenntnisse, c) die Leistung, d) den Vertrag und e) die Compliance jeder Vertragspartei.

An den Sitzungen des Überwachungsausschusses für Bevollmächtigte nehmen verschiedene Mitarbeiter der L&G-Gruppe teil (die im Namen des Anlageverwalters und der Vertriebsstelle in Bezug auf die Dienstleistungen, die diese für den Anlageverwalter erbringen, handeln), die von den betreffenden designierten Verantwortlichen als angemessen erachtet werden. Der Gesellschaftssekretär ist bei jeder Sitzung anwesend, um das Protokoll zu erstellen und sicherzustellen, dass die Teilnehmer in der Lage sind, sich voll und ganz der Sitzung zu widmen, und dass das Protokoll korrekt und unvoreingenommen ist.

Der Überwachungsausschuss für Bevollmächtigte erörtert alle Angelegenheiten, die sich aus den Tages-, Monats- oder Ausnahmeberichten ergeben. Der designierte Verantwortliche für die Anlageverwaltung, den Vertrieb und die aufsichtsrechtliche Compliance berichtet dem Verwaltungsrat ad hoc über jede Angelegenheit, die seiner Meinung nach einer Eskalation bedarf. Herr Weeks berichtet dem Verwaltungsrat vierteljährlich über die Tätigkeit des Überwachungsausschusses für Bevollmächtigte.

Der designierte Verantwortliche für das Risikomanagement kann an den Sitzungen des Überwachungsausschusses für Bevollmächtigte teilnehmen, um sich zu den Risikomanagementprozessen und -verfahren der Bevollmächtigten sowie zu allen Ausnahmen, die während des Berichtszeitraums aufgetreten sind, zu äußern.

Der Überwachungsausschuss für Bevollmächtigte hat keine vom Verwaltungsrat per se delegierten Funktionen, sondern bietet ein Forum, in dem der designierte Verantwortliche für die Anlageverwaltung, den Vertrieb und die aufsichtsrechtliche Compliance die Bevollmächtigten so effizient und effektiv wie möglich überwachen kann und das es den Schlüsselpersonen der L&G-Gruppe, dem Anlageverwalter und der Vertriebsstelle (die täglich mit den Bevollmächtigten zusammenarbeiten) ermöglichen soll, Beiträge zu den Bewertungen des die Bevollmächtigten überwachenden Verwaltungsratsmitglieds über die Aufsicht der Bevollmächtigten zu liefern. Die Tagesordnungen werden den Teilnehmern vor jeder Sitzung zugestellt, und es werden detaillierte Protokolle geführt und anschließend verteilt.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

###### Überwachung der Bevollmächtigten (Fortsetzung)

Jede delegierte Vereinbarung unterliegt einem Leistungsvertrag (SLA), der wichtige Performance-Indikatoren („KPIs“) enthält. Die KPIs werden vom die Bevollmächtigten überwachenden Verwaltungsratsmitglied im Rahmen seiner Aufsichtsfunktion kontrolliert und überprüft und im Detail auf den Sitzungen des Überwachungsausschusses für Bevollmächtigte erörtert. Ungeachtet der Übertragung von Aufgaben trifft der Verwaltungsrat jederzeit alle wichtigen strategischen und operativen Entscheidungen, die den Anlageverwalter und die von ihm verwalteten Investmentfonds betreffen. Der Verwaltungsrat hebt seine Verantwortung für die delegierten Funktionen niemals auf.

###### Risikoüberwachung\*

Der Risikoüberwachungsausschuss wird vom designierten Verwaltungsratsmitglied für das Management von Fondsrisiken und operativen Risiken Andrew Savage geleitet und kommt monatlich zusammen, um Angelegenheiten zu erörtern, die sich aus den monatlichen Berichten der Bevollmächtigten ergeben, wobei ein Schwerpunkt auf „Fondsrisiko“ (d. h. anlagebezogenes Risiko) und „operativem Risiko“ (d. h. Geschäfts-/Unternehmensrisiko) liegt. Herr Savage berichtet dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft vierteljährlich über die Tätigkeiten des Risikoüberwachungsausschusses. Herr Savage eskaliert jedoch auf Ad-hoc-Basis Angelegenheiten, bei denen er eine umgehende Entscheidung für erforderlich hält, an den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft.

Die Effektivität des Risikoüberwachungsausschusses und der Wert seiner Beteiligten wird vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft auf jährlicher Basis oder, falls für erforderlich erachtet, auch öfter überprüft.

###### Berichterstattung durch die Bevollmächtigten

Herr Savage erhält monatliche und vierteljährliche Berichte vom Anlageverwalter und jedem der anderen Bevollmächtigten, die sämtliche operativen Risiken (d. h. Geschäfts-/Unternehmensrisiken) erfassen sollen, die durch die Tätigkeiten der Bevollmächtigten entstehen.

Die vierteljährlichen Berichte von den Bevollmächtigten werden an den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft verteilt und von diesem in ihrer Gesamtheit beurteilt. Die Kontrollverfahren für die Identifizierung von Risiken, die das finanzielle, operative, Compliance- und Risikomanagement abdecken, sind in den Betrieb der Bevollmächtigten eingebettet. Deshalb sollen die vierteljährlichen Berichte die Aufmerksamkeit des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft auf Probleme lenken, die in den Systemen und Kontrollverfahren der einzelnen Bevollmächtigten entstehen.

Für dieses Berichtsjahr wurden dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft von dem designierten Verantwortlichen für das Management von Fondsrisiken und operativen Risiken oder dem designierten Verantwortlichen für die aufsichtsrechtliche Compliance, den Vertrieb und die Anlageverwaltung keine wesentlichen oder außergewöhnlichen Probleme oder Verstöße gemeldet. Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft hat dem Verwaltungsrat der Gesellschaft bestätigt, dass er sich überzeugt hat, dass die jeweiligen Bevollmächtigten das Fachwissen, die Kenntnisse und die Erfahrung haben, die für die Ausübung der ihnen übertragenen Aufgaben notwendig sind.

\*Diese Angaben gelten als wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

##### Berichterstattung durch die Bevollmächtigten (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

#### Kreditrisiko\*

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

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

Das Kreditrisiko wird in Anmerkung 12 zum Jahresabschluss genauer erörtert.

\*Diese Angaben gelten als wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

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

##### Liquiditätsrisiko\*

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

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

##### Transferrisiko\*

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

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

##### Abwicklungsrisiko\*

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

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

\*Diese Angaben gelten als wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.



## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

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

##### Abwicklungsrisiko\* (Fortsetzung)

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

##### Anlageperformancerisiko\*

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

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

##### Marktrisiko\*

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

Das Marktrisiko wird in Anmerkung 12 zum Jahresabschluss genauer erörtert.

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

##### Systemrisiko

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

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

\*Diese Angaben gelten als wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

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

##### Börsenhandelsrisiko

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

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

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

##### Prozessrisiko

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

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

##### Reputationsrisiko

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

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

##### Reputationsrisiko (Fortsetzung)

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

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

##### Produktisiko

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

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

##### Betrugsrisiko

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

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

##### Rechtliches / aufsichtsrechtliches Risiko

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

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

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

##### Compliance-Risiko

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

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

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

##### Finanzberichterstattungsrisiko

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

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

##### Finanzberichterstattungsrisiko (Fortsetzung)

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

##### Brexit-Risiko

Das Brexit-Risiko bezeichnet die Unsicherheit im Zusammenhang mit dem Austritt Großbritanniens aus der Europäischen Union und die potenziellen Auswirkungen auf die Geschäftstätigkeit der Gesellschaft und der Bevollmächtigten.

Das Brexit-Risiko wird von der Verwaltungsgesellschaft gesteuert und durch Delegation an die Vertriebsstelle gemindert, deren Rechts- und Compliance-Teams die Entwicklungen bezüglich des Brexits überwachen.

Es wurde eine LGIM ETF Brexit Working Group (die „Arbeitsgruppe“) eingerichtet, die mindestens einmal wöchentlich zusammentritt, um eine regelmäßige Überwachung und Bewertung der potenziellen Folgen des Brexit sicherzustellen. Die Arbeitsgruppe setzt sich zusammen aus Vertretern der Vertriebsstelle, darunter: Mitarbeiter aus der Rechts- und Compliance-Abteilung, dem operativen Geschäft und der Geschäftsleitung. Dadurch soll gewährleistet werden, dass alle potenziellen Risiken für die Gesellschaft durch den Brexit erkannt, gesteuert und verringert werden. Der Verwaltungsrat erhält regelmäßig und mindestens vierteljährlich Berichte, und Vertreter der Arbeitsgruppe nehmen an Informationsveranstaltungen der Branche teil.

LGIM setzt eine Reihe von Maßnahmen um, um sich auf verschiedene Szenarien vorzubereiten, auch solche, die sich auf die organisatorische Unternehmensführung und das operative Geschäft auswirken.

#### Überwachungs- und Überprüfungstätigkeiten

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

Im vorliegenden Berichtsjahr berichtete die Verwahrstelle quartalsmäßig an den Verwaltungsrat.

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

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

###### Überprüfung der Wirksamkeit

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

#### E. Anteilinhaber-Beziehungen

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

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

Wie oben erwähnt, unterhält die Vertriebsstelle eine Website (<http://www.lgimETF.com>), auf der Anlegern eine Vielzahl zusätzlicher Informationen zur Verfügung stehen (gemäß Angabe in den Angebotsunterlagen) zusammen mit einer E-Mail-Adresse ([fundsales@lgim.com](mailto:fundsales@lgim.com)) und Telefonnummer (+44 34 5070 8684) für Anleger, die zusätzliche Informationen wünschen. Angesichts des Vorstehenden ist der Verwaltungsrat der Meinung, dass er angemessene Kommunikationswege für Anteilhaber unterhält, und er hält es nicht für erforderlich, dass alle Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft an der Jahreshauptversammlung („JHV“) der Gesellschaft teilnehmen.

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

##### 1. Anteilinhaberversammlungen

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

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

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

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

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

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

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

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Corporate-Governance-Erklärung (Fortsetzung)

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

##### 2. Ergebnisse von Hauptversammlungen

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

#### Geschäftsbücher

Wie im Abschnitt „Beschreibung der Obliegenheiten des Verwaltungsrats“ auf den Seiten 15 bis 16 beschrieben, obliegt es dem Verwaltungsrat, eine ordnungsgemäße Buchführung durch die Gesellschaft sicherzustellen. Um dies zu erreichen, hat die Verwaltungsgesellschaft einen Verwalter bestellt, um sicherzustellen, dass die Anforderungen gemäß Section 281 des Companies Act erfüllt werden.

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

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

#### Wirtschaftlichkeitserklärung

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

Der Verwaltungsrat hat die Aussichten der Gesellschaft für den Zweijahreszeitraum bis zur Jahreshauptversammlung („JHV“) 2022 bewertet. Der Verwaltungsrat hält zwei Jahre für einen angemessenen Zeitraum, über den die Aussichten der Gesellschaft bewertet werden können, da er nicht mit Änderungen im Ziel der Gesellschaft oder anderen Ereignissen rechnet, welche die Gesellschaft daran hindern, in dem genannten Zeitraum ihre Geschäftstätigkeit weiterzuführen. Des Weiteren geht der Verwaltungsrat nicht davon aus, dass die derzeit wichtigsten Risiken der Gesellschaft und die Angemessenheit der risikomindernden Kontrollen während dieses Zeitraums wesentlichen Änderungen unterworfen sein werden. Ein über zwei Jahre hinausgehender Zeitraum ist mit einem Ausmaß zukünftiger Unsicherheiten verbunden, für das eine Wirtschaftlichkeitserklärung nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht sinnvoll abgegeben werden kann.

In früheren Jahren hat der Verwaltungsrat die Aussichten der Gesellschaft für einen Dreijahreszeitraum bewertet; aufgrund der COVID-19-Pandemie und der damit verbundenen Marktunsicherheit hat der Verwaltungsrat jedoch beschlossen, dass ein Zweijahreszeitraum für die diesjährige Beurteilung der Wirtschaftlichkeit angemessener ist.

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

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



## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Wirtschaftlichkeitserklärung (Fortsetzung)

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

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

Auf der Grundlage seiner Einschätzungen und der Prozesse der Gesellschaft zur Überwachung der wichtigsten Risiken und Ungewissheiten der Gesellschaft und der Reaktionen darauf geht der Verwaltungsrat davon aus, dass die berechnete Erwartung besteht, dass die Gesellschaft über die zwei Jahre bis zur JHV 2022 ihren Betrieb fortführt und ihre Verbindlichkeiten bei Fälligkeit begleicht.

### Ergebnisse und Dividenden

Die Ergebnisse des Geschäftsjahres sind in der Gesamtergebnisrechnung auf den Seiten 79 bis 87 aufgeführt.

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2020 und 30. Juni 2019 wurden die folgenden Ausschüttungen von den nachstehend aufgeführten jeweiligen Fonds (oder ihren Anteilklassen) gezahlt:

Fonds	Anteilklasse	ISIN	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BHZKHS06	1.564.170 \$	2.168.116 \$
L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF	EUR Distributing ETF	IE00BSVYHT42	Nicht zutreffend	136.814 €
L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BSVYHV63	Nicht zutreffend	1.673.648 \$
L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF	GBP Hedged Distributing ETF	IE00BZ03M525	Nicht zutreffend	669.551 \$
L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BSVYHQ11	Nicht zutreffend	124.217 \$
L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF	GBP Hedged Distributing ETF	IE00BZ03M301	Nicht zutreffend	29.189 \$
L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF	USD Distributing ETF	IE00BSVYHP04	Nicht zutreffend	13.277.586 \$

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 wurden sonst keine Dividenden aus den anderen Fonds gezahlt.

### Erklärung zur Fortführung der Gesellschaft

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

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Überblick über Geschäftsentwicklung und -ergebnis

Ein Bericht über das Geschäft ist in den Abschnitten „Informationen über die Gesellschaft“ auf Seite 4 und „Fondsbericht“ auf den Seiten 9 bis 14 enthalten. Der Verwaltungsrat erwartet außer den im Jahresabschluss genannten keine Veränderungen in der Struktur der Gesellschaft oder den Anlagezielen der Fonds.

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

Zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 hatte die Gesellschaft keine Beschäftigten.

### 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 Geschäftsjahr eingegangenen Transaktionen mit nahestehenden Personen die oben dargelegten Verpflichtungen einhalten.

### Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres

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

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF wurde am 6. August 2019 von der Zentralbank zugelassen und am 17. September 2019 an der Londoner Börse (London Stock Exchange) sowie am 20. November 2019 an der Borsa Italiana und am 27. Januar 2020 an der Frankfurter Börse gelistet.

Am 4. September 2019 erhielten die im Anteilinhaberregister 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 Einzelemittent 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.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Der L&G Emerging Markets Equity UCITS ETF wurde am 15. Oktober 2019 von der Zentralbank zugelassen.

Der L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF wurde am 6. November 2019 von der Zentralbank zugelassen und am 10. Dezember 2019 an der Londoner Börse (London Stock Exchange) sowie am 27. Januar 2020 an der Frankfurter Börse und der Borsa Italiana gelistet.

Am 1. Dezember 2019 ersetzte The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, die BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited als die Verwahrstelle der Gesellschaft.

Am 14. Januar 2020 wurde Herr Feargal Dempsey als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

Am 23. März 2020 wurde Herr Howie Li als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

Am 23. März 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für den L&G LOIM Euro Government Bond Fundamental UCITS ETF.

Mark Weeks hat sein Amt als Mitglied des Verwaltungsrats der Gesellschaft am 31. März 2020 niedergelegt.

Mit Wirkung vom 31. März 2020 ersetzte die LGIM Managers (Europe) Limited (die „neue Verwaltungsgesellschaft“) die LGIM ETF Managers Limited als Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft. Die neue Verwaltungsgesellschaft mit eingetragener Adresse in 33/34 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland, wurde am 14. August 2017 in Irland als Gesellschaft mit beschränkter Haftung gegründet. Sie ist von der Zentralbank als AIFM gemäß den AIFM-Vorschriften und als OGAW-Verwaltungsgesellschaft gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen und untersteht deren Aufsicht. Die maßgeblichen Aktualisierungen im Verkaufsprospekt der Gesellschaft wurden anschließend am 20. April 2020 von der Zentralbank zur Kenntnis genommen, in Übereinstimmung mit der Aktualisierung des Verkaufsprospekts zur Berücksichtigung der Umstellung der Gesellschaft auf das Abwicklungsmodell International Central Securities Depository (das „ICSD“-Modell“).

Mit Wirkung vom 20. April 2020 führte die Gesellschaft das ICSD-Abwicklungsmodell ein, das eine zentralisierte Abwicklung für an mehreren Börsen durchgeführte Transaktionen ermöglicht. Der Verkaufsprospekt der Gesellschaft, die Fondssatzung sowie alle Nachträge wurden am 20. April 2020 aktualisiert, um den Übergang auf das ICSD-Abwicklungsmodell zu berücksichtigen.

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 bisherige Abschlussprüfer der Gesellschaft („KPMG“) die maximal zulässige Zeitspanne tätig gewesen war, war die Gesellschaft verpflichtet, ab der gesetzlichen Abschlussprüfung im Jahr 2020 eine neue Prüfungsgesellschaft zu bestellen. Nach einer vom Prüfungsausschuss durchgeführten Überprüfung von Prüfungsgesellschaften wurde EY mit einem Wirksamkeitsdatum vom 1. April 2020 zum Abschlussprüfer der Gesellschaft bestellt. KPMG wurde am 1. April 2020 als Abschlussprüfer der Gesellschaft abgelöst.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Am 5. Juni 2020 wurden die folgenden Fonds an der Swiss SIX Exchange gelistet:

- L&G Clean Water UCITS ETF
- L&G Artificial Intelligence UCITS ETF
- L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF
- L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF
- L&G Battery Value-Chain UCITS ETF
- L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Am 23. Juni 2020 wurde Frau Patrizia Libotte als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

#### COVID-19

Seit Januar 2020 sind die globalen Finanzmärkte vom Coronavirus („COVID-19“) betroffen. COVID-19 hat zu erheblichen Unsicherheiten geführt und Störungen in der Wirtschaft und in unserem Alltag verursacht. Die Finanzmärkte haben auf diese Meldungen heftig reagiert; es machten sich Sorgen bezüglich der möglichen weltweiten Auswirkungen der Pandemie auf die Konjunktur breit. Die langfristigen Auswirkungen auf die Weltwirtschaft und die globalen Märkte hängt von der generellen Größenordnung und der Dauer des Ausbruchs sowie von den Maßnahmen von staatlicher Seite und vonseiten der Zentralbanken ab. Der Verwaltungsrat beobachtet kontinuierlich die Lage und sowohl die Verwaltungsgesellschaft als auch der Anlageverwalter haben ihre jeweilige Geschäftskontinuitätsplanung umgesetzt.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse im Geschäftsjahr.

### Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres

Am 16. Juli 2020 wurde David Fagan als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

Am 1. September 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für die folgenden Fonds der Gesellschaft:

- L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF;
- L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF;
- L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF; und
- L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF.

Am 11. September 2020 wurde Feargal Dempsey zum Vorsitzenden des Verwaltungsrats der Gesellschaft ernannt.

## Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

### Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Am 11. September 2020 wurden die folgenden neuen Fonds der Gesellschaft von der Zentralbank zugelassen:

- L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF;
- L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF;
- L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF;
- L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF; und
- L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF.

### Unabhängige Abschlussprüfer

Der Verwaltungsrat hat mit Wirkung vom 1. April 2020 Ernst & Young als Abschlussprüfer für die Gesellschaft bestellt. Seit

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

Für den Verwaltungsrat

---

Verwaltungsratsmitglied

---

Verwaltungsratsmitglied

Datum: 16. Oktober 2020

## Bericht des Prüfungsausschusses

Im März 2014 richtete die Gesellschaft einen Prüfungsausschuss ein, der sich aus den zwei unabhängigen, nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern Eimear Cowhey und Adrian Waters zusammensetzt (zusammen der „Prüfungsausschuss“).

Herr Waters ist Vorsitzender des Prüfungsausschusses.

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

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

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

Am 18. Oktober 2019 fand eine Sitzung zu folgendem Zweck statt:

- Überprüfung des Prüfungsberichts (Audit Findings Report) des Prüfungsberichts (Audit Findings Report) des Abschlussprüfers sowie der Wirksamkeit des Prüfungsprozesses;
- Überprüfung und Genehmigung des Jahresabschlusses der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum Juni 2019;
- Prüfung der von KPMG im Berichtszeitraum erbrachten prüfungsfremden Leistungen;
- Überprüfung und Genehmigung der Vollständigkeitserklärung der Gesellschaft an die Abschlussprüfer und der entsprechenden Erklärungen (Letters of Comfort) von verbundenen Parteien;
- anfängliche Gespräche mit der Verwaltungsgesellschaft über die Rotation von Abschlussprüfern und das Verfahren im Zusammenhang mit der Auswahl des neuen gesetzlichen Abschlussprüfers führen.

An der Sitzung nahmen Frau Cowhey und Herr Waters teil (die beiden Mitglieder des Prüfungsausschusses) und auf deren Einladung zwei Vertreter von KPMG, Mitglieder des Innenrevisionsteams der Muttergesellschaft (Legal & General Investment Management (Holdings) Limited) sowie weitere Vertreter aus dem operativen und dem Finanzbereich der Muttergesellschaft.

Am 27. Februar 2020 fand eine zweite Sitzung zu folgendem Zweck statt:

- Prüfung aktueller Informationen der Innenrevisionsfunktion der Muttergesellschaft im Zusammenhang mit der Durchführung des Innenrevisionsplans 2019 und aktueller Informationen zur Innenrevision 2020;
- Prüfung und Genehmigung des Entwurfs des ungeprüften Halbjahresberichts und -abschlusses für das Geschäftshalbjahr zum 31. Dezember 2019;
- Prüfung der Richtlinien der Gesellschaft in Bezug auf von KPMG erbrachte prüfungsfremde Leistungen sowie eine Überprüfung der tatsächlichen Ausgaben 2019 im Vergleich zum Budget und das Budget für 2020.

An der Sitzung nahmen Frau Cowhey und Herr Waters teil (die beiden Mitglieder des Prüfungsausschusses) und auf deren Einladung Mitglieder des Innenrevisionsteams der Muttergesellschaft, Vertreter aus den operativen Bereichen der Muttergesellschaft sowie Vertreter des Verwalters.

## Bericht des Prüfungsausschusses (Fortsetzung)

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

Am 11. Mai 2020 fand eine dritte Sitzung zu folgendem Zweck statt:

- Überprüfung der Geschäftsordnung und des Audit-Kalenders des Prüfungsausschusses;
- Prüfung der internen finanziellen Kontroll- und Risikomanagementsysteme;
- Prüfung der Verfahren zur Vermeidung und Aufdeckung von Betrug, einschließlich Vorkehrungen für „Whistleblowing“;
- Überprüfung des Budgets für prüfungsfremde Leistungen und der zugrunde liegenden Richtlinien;
- Prüfung der Rechnungslegungsgrundsätze;
- Prüfung und Genehmigung des Prüfungsplans für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020;
- Prüfung der Bilanzierungsgrundsätze und -praktiken und Identifizierung und Berücksichtigung wesentlicher Finanzberichterstattungsrisiken und Beurteilungen;
- Überprüfung der Vergütung und der Konditionen für die Beauftragung des neuen externen Abschlussprüfers.

An der Sitzung nahmen Frau Cowhey und Herr Waters teil (die beiden Mitglieder des Prüfungsausschusses) und auf deren Einladung Frau Amy Ellison, Mitglied des Verwaltungsrats der Gesellschaft, ein Mitglied des Financial Crime Teams der Muttergesellschaft, Vertreter aus den operativen Bereichen der Muttergesellschaft sowie Mitglieder von den neu bestellten externen Abschlussprüfern, Ernst & Young.

### Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Innenrevision

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

### Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Bestellung der Abschlussprüfer

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 bisherige Abschlussprüfer des Unternehmens („KPMG“) die maximal zulässige Zeitspanne tätig gewesen war, war die Gesellschaft verpflichtet, ab der gesetzlichen Abschlussprüfung im Jahr 2020 eine neue Prüfungsgesellschaft zu bestellen.

Wie in der Geschäftsordnung des Prüfungsausschusses festgelegt, hatte der Ausschuss die Aufsicht über das Auswahlverfahren und hat sichergestellt, dass alle sich an der Ausschreibung beteiligenden Firmen Zugang zu allen benötigten Informationen und Personen während des Ausschreibungsverfahrens hatten. Dieses Verfahren begann im Oktober 2019 und führte dazu, dass Ernst & Young („EY“) mit Wirkung vom 1. April 2020 zu den neuen Abschlussprüfern der Gesellschaft bestellt wurden.

Der Prüfungsausschuss hat die Effektivität und Objektivität der Prüfungshandlungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 sowie die Effektivität, Leistung und Unabhängigkeit von EY beurteilt und ist zu dem Schluss gekommen, dass EY ihren Pflichten gegenüber Anteilhabern als unabhängiger Abschlussprüfer der Gesellschaft nachgekommen ist.

## Bericht des Prüfungsausschusses (Fortsetzung)

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

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

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

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

Weitere Informationen finden Sie in der Corporate-Governance-Erklärung auf Seite 17.

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

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 waren es die folgenden Angelegenheiten, die ggf. nach Absprache mit den Abschlussprüfern dem speziellen Fokus des Prüfungsausschusses unterlagen:

### Bewertung von Anlagen

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

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

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

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



## Bericht des Prüfungsausschusses (Fortsetzung)

### Wesentliche erörterte Fragen im Zusammenhang mit dem Abschluss (Fortsetzung)

#### Besitz von Anlagen:

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

Die Verantwortung für die Überwachung des Besitzes von Anlagen wurde an die Verwahrstelle delegiert. Die Aufgaben der Verwahrstelle sind in der Corporate-Governance-Erklärung auf Seite 34 und im Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber auf Seite 57 enthalten.

Die Verwahrstelle berichtet der Verwaltungsgesellschaft regelmäßig, einschließlich des Besitzes von Anlagen. Der Verwaltungsrat überprüft regelmäßig die Mechanismen, die die Verwaltungsgesellschaft eingerichtet hat, um die Verwahrstelle zu überwachen, einschließlich der etablierten Kontrollen zur Überwachung des Besitzes von Anlagen. Eine Erklärung zur Berichterstattung der einzelnen Bevollmächtigten ist in der Corporate-Governance-Erklärung auf den Seiten 17 bis 47 enthalten.

Zur Prüfung und Billigung des Prüfungsplans von EY durch den Prüfungsausschuss erfolgte am 11. Mai 2020 ein Treffen des Prüfungsausschusses mit EY, bei dem insbesondere der Prüfungsansatz in Bezug auf die Bewertung und den Besitz von Anlagen besprochen wurde. Nach dieser Besprechung war der Prüfungsausschuss überzeugt, dass die vorgenommenen Beurteilungen und angewandten Methoden umsichtig und angebracht waren, und dass die richtige bilanzielle Behandlung angewandt wurde. EY berichtet dem Prüfungsausschuss über ihre Beurteilung der Bewertungsmethoden und -verfahren der Gesellschaft, die im Geschäftsjahr angewandt wurden.

Für den Prüfungsausschuss

---

Adrian Waters, Vorsitzender des Prüfungsausschusses Eimear Cowhey

Datum: 16. Oktober 2020

## Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber vom 30. Juni 2020

Für den Berichtszeitraum vom 1. Juli 2019 bis zum 30. Juni 2020 (der „Berichtszeitraum“)

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

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

### Aufgaben der Verwahrstelle

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

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

### Grundlage des Prüfvermerks der Verwahrstelle

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

### Prüfvermerk

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

(i) gemäß den Beschränkungen in der Gründungsurkunde und Satzung (Gründungsdokumente) und den Vorschriften bezüglich der Anlage- und Kreditaufnahmebefugnisse der Gesellschaft; und

(ii) auch ansonsten gemäß den Bestimmungen der Gründungsdokumente und den Vorschriften.

---

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

Datum: 16. Oktober 2020

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

### Bericht über die Abschlussprüfung

#### Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Legal & General UCITS ETF Plc (die „Gesellschaft“) für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2019 bis zum 30. Juni 2020 geprüft, der aus der Gesamtergebnisrechnung, der Bilanz, der Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, der Kapitalflussrechnung, der Aufstellung der Vermögenswerte und den Anmerkungen zum Jahresabschluss, einschließlich der Zusammenfassung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze in Anmerkung 1 besteht. Der für seine Aufstellung verwendete Rahmen für die Finanzberichterstattung waren das irische Recht und die International Financial Reporting Standards (IFRS), wie sie in der Europäischen Union anzuwenden sind.

Unserer Auffassung nach vermittelt der Jahresabschluss:

- ein zum 30. Juni 2020 den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und der Finanzlage der Gesellschaft und des Gewinns für das dann endende Geschäftsjahr vermitteln;
- ist ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit IFRS, wie sie in der Europäischen Union anzuwenden sind, erstellt worden; und
- wurde ordnungsgemäß aufgestellt gemäß den Bestimmungen des Companies Act 2014, der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 und der Vorschriften des Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Abschnitt 48(1)) betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren von 2019.

#### Grundlage des Prüfvermerks

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

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

#### Die wichtigen Prüfungssachverhalte

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

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

### Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

Risiken	Unsere Reaktion auf die Risiken	Wichtige Beobachtungen
<p>Existenz von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die außerhalb des Depotbankennetzes gehalten werden</p> <p>Unsere Ansicht nach ist die Existenz von finanziellen Vermögenswerten mit einem beizulegenden Zeitwert von 920.773.011 US\$ (2019: 1.019.188.899 US\$) und von finanziellen Verbindlichkeiten mit einem beizulegenden Zeitwert von 1.702.043 US\$ (2019: 938.727 US\$) ein wesentlicher Prüfungssachverhalt, da es sich um eine zentrale Komponente der Gesamtbilanz der Gesellschaft handelt.</p> <p>Bitte beachten Sie die folgenden Anmerkungen zum Jahresabschluss: Anmerkung 1 B. – Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze – Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten; Anmerkung 5 – Sicherheiten; und Anmerkung 13 – Saldierung und Beträge, die Aufrechnungsverträge oder ähnlichen Vereinbarungen unterliegen</p> <p>Bewertung von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</p> <p>Unsere Ansicht nach ist die Bewertung von finanziellen Vermögenswerten mit einem beizulegenden Zeitwert von 4.868.789.635 US\$ (2019: 3.406.480.892 US\$) und von finanziellen Verbindlichkeiten mit einem beizulegenden Zeitwert von 1.702.043 US\$ (2019: 938.727 US\$) ein wesentlicher Prüfungssachverhalt, da es sich um eine zentrale Komponente der Gesamtbilanz der Gesellschaft handelt.</p> <p>Bitte beachten Sie die folgenden Anmerkungen zum Jahresabschluss: Anmerkung 1 B. – Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze – Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten; Anmerkung 5 – Sicherheiten; und Anmerkung 12 – Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken</p>	<p>Wir haben vom Verwalter (BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company) der Gesellschaft zum 30. Juni 2020 eine Portfolioaufstellung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten erhalten, in der die außerhalb des Depotbankennetzes gehaltenen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aufgeführt werden (derivative Finanzinstrumente und umgekehrte Pensionsgeschäfte)</p> <p>Wir haben die Angemessenheit der Existenz aller finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten, die außerhalb des Depotbankennetzes gehalten werden, beurteilt, indem wir wie folgt vorgegangen sind:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Wir haben ein Verständnis der Schlüsselkontrollen erlangt, die in Bezug auf den Abstimmungsprozess für finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingeführt wurden. Dies umfasste die Einholung des Prüfberichts für den Verwalter bezogen auf Dienstleistungsorganisationen und die Identifizierung der Schlüsselkontrollen beim Verwalter im Zusammenhang mit dem Abstimmungsprozess für die Anlagen. Wir haben diese Schlüsselkontrollen nicht geprüft und uns nicht darauf berufen.</li> <li>• Wir haben direkt von der Gegenpartei der einzelnen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zum Jahresende außerhalb des Depotbankennetzes gehalten wurden, unabhängige Bestätigungen eingeholt, um die Existenz dieser finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zu bestätigen. Bei wesentlichen Unterschieden haben wir Nachforschungen angestellt.</li> </ul> <p>Wir haben die Aufstellung der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 30. Juni 2020 vom Verwalter eingeholt.</p> <p>Wir haben die Angemessenheit der Bewertung aller finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten beurteilt, indem wir wie folgt vorgegangen sind:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Wir haben ein Verständnis der Schlüsselkontrollen erlangt, die in Bezug auf den Bewertungsprozess für finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingeführt wurden. Dies umfasste die Einholung des Prüfberichts für den Verwalter bezogen auf Dienstleistungsorganisationen und die Identifizierung der Schlüsselkontrollen beim Verwalter im Zusammenhang mit dem Bewertungsprozess. Wir haben diese Schlüsselkontrollen nicht geprüft und uns nicht darauf berufen.</li> <li>• Wir haben die Werte der Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit den notierten Preisen oder den Verkaufspreisen verglichen. Wir haben den beizulegenden Zeitwert von derivativen Finanzinstrumenten und umgekehrten Pensionsgeschäften mithilfe branchenüblicher Modelle neu berechnet und dabei die Angemessenheit der Annahmen und Datenparameter beurteilt, die vom Verwaltungsrat zur Bewertung dieser erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten herangezogen werden.</li> </ul>	<p>Aus der Durchführung unserer Prüfungshandlungen haben wir keine Probleme hinsichtlich dieser wichtigen Prüfungssachverhalte festgestellt.</p> <p>Aus der Durchführung unserer Prüfungshandlungen haben wir keine Probleme hinsichtlich dieser wichtigen Prüfungssachverhalte festgestellt.</p>

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

### Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

#### Anwendung des Wesentlichkeitskriteriums

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

#### Wesentlichkeit

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

Als Wesentlichkeitsschwelle legten wir 0,5 % (2019: 1 %) des Nettoinventarwerts jedes Teilfonds fest. Wir sind der Auffassung, dass der Nettoinventarwert eine angemessene Bewertungsbasis darstellt, da Adressaten unter Umständen mehr Wert darauf legen als auf die Erträge.

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

#### Performance-Wesentlichkeit

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

Auf Grundlage unserer Risikobeurteilungen, zusammen mit unserer Beurteilung der allgemeinen Kontrollumgebung der Gesellschaft, legten wir die Performance-Wesentlichkeit mit 50 % unserer Wesentlichkeit fest. Wir haben diesen Prozentsatz aufgrund unseres Wissens bezogen auf die Gesellschaft sowie ihre Branche sowie wegen der Tatsache, dass es sich um eine Prüfung im ersten Jahr handelt, gewählt.

#### Meldeschwelle

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

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

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

### Überblick über den Umfang unseres Prüfberichts

#### Anpassung des Umfangs

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

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

### Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

#### Überblick über den Umfang unseres Prüfberichts (Fortsetzung)

#### Schlussfolgerungen in Bezug auf wesentliche Risiken, Unternehmensfortführung und Wirtschaftlichkeitserklärung

Wir haben in Bezug auf die folgenden Angaben im Jahresbericht, im Zusammenhang mit denen wir gemäß den ISAs (Irland) verpflichtet sind, Ihnen gegenüber Bericht zu erstatten, wenn wir wesentliche Sachverhalte hinzufügen oder Ihre Aufmerksamkeit dahingehend lenken müssen, keinerlei Bericht zu erstatten:

- die Angaben im Jahresbericht auf den Seite 38–45, welche die wesentlichen Risiken beschreiben und erklären, wie sie gesteuert oder verringert werden;
- die Bestätigung des Verwaltungsrats auf Seite 29 in diesem Jahresbericht, dass er eine robuste Beurteilung der wesentlichen Risiken vorgenommen hat, denen die Gesellschaft ausgesetzt ist, eingeschlossen Risiken, die ihr Geschäftsmodell, ihre zukünftige Performance, ihre Zahlungsfähigkeit und ihre Liquidität gefährden könnten;
- die Erklärung des Verwaltungsrats auf Seite 48 im Jahresabschluss dahingehend, ob es nach Ansicht des Verwaltungsrats angemessen war, bei der Erstellung des Jahresabschlusses von der Unternehmensfortführung auszugehen und die Feststellung des Verwaltungsrats von wesentlichen Unsicherheiten bezogen auf die Fähigkeit der Gesellschaft, für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum der Genehmigung des Jahresabschlusses weiterhin von der Unternehmensfortführung auszugehen;
- ob die gemäß den Börsenzulassungsregeln erforderliche Erklärung des Verwaltungsrats im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung im Einklang mit Börsenzulassungsregel 6.8.3(3) in einem wesentlichen Widerspruch zu dem im Rahmen der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse steht; oder
- die Erklärung des Verwaltungsrats auf Seite 47 im Jahresbericht, wie er die Aussichten der Gesellschaft beurteilt hat, über welchen Zeitraum er dies getan hat und warum er diesen Zeitraum für angemessen hält, sowie seine Erklärung, ob er angemessenerweise davon ausgeht, dass die Gesellschaft im Zeitraum seiner Beurteilung fortgeführt wird und die Verbindlichkeiten bei Fälligkeit erfüllen kann, einschließlich damit verbundener Offenlegungen, die auf erforderliche Einschränkungen oder Annahmen aufmerksam machen.

#### Sonstige Informationen

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

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

Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

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

### Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

#### Überblick über den Umfang unseres Prüfberichts (Fortsetzung)

##### Sonstige Informationen (Fortsetzung)

In diesem Zusammenhang haben wir außerdem nichts zu berichten in Bezug auf unsere Verantwortung, die folgenden Sachverhalte in den sonstigen Angaben genauer zu beleuchten und als unkorrigierte Falschangaben der sonstigen Angaben zu berichten, wenn wir schlussfolgern, dass diese Sachverhalte die folgenden Bedingungen erfüllen:

- *Fair, ausgewogen und verständlich* – die Erklärung des Verwaltungsrats, dass er den Jahresbericht und Jahresabschluss in ihrer Gesamtheit für fair, ausgewogen und verständlich hält und darin die Informationen zur Verfügung gestellt werden, die für Anteilhaber notwendig sind, um die Ergebnisentwicklung, das Geschäftsmodell und die Strategie der Gesellschaft bewerten zu können, steht in einem wesentlichen Widerspruch zu den im Rahmen der Prüfung gewonnenen Erkenntnissen; oder
- *Berichterstattung des Prüfungsausschusses* – der Abschnitt, in dem die Arbeit des Prüfungsausschusses beschrieben wird, spiegelt die von uns dem Prüfungsausschuss mitgeteilten Angelegenheiten nicht angemessen wider; oder
- *Erklärung des Verwaltungsrats zur Einhaltung des britischen Corporate Governance Code* – die gemäß den Börsenzulassungsregeln erforderlichen Teile der Erklärung des Verwaltungsrats hinsichtlich der Einhaltung des britischen Corporate Governance Code, der konkrete Vorschriften zur Prüfung durch den Abschlussprüfer gemäß Börsenzulassungsregel 6.8.6 enthält, legen Abweichungen von maßgeblichen Bestimmungen des britischen Corporate Governance Code nicht ordnungsgemäß offen.

##### Prüfungsurteile zu sonstigen, im Companies Act 2014 vorgeschriebenen Angelegenheiten

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

- unserer Ansicht nach die im Bericht des Verwaltungsrats gemachten Angaben in Einklang mit dem Jahresabschluss stehen; und
- unserer Ansicht nach der Bericht des Verwaltungsrats in Einklang mit dem Companies Act 2014 erstellt wurde

Wir haben alle Angaben und Erklärungen eingeholt, die wir für die Zwecke unserer Prüfung für notwendig erachteten.

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

Ferner berichten wir im Zusammenhang mit den in der Corporate-Governance-Erklärung auf den Seiten 17 bis 47 erteilten Informationen, dass:

- uns auf der Grundlage unseres im Zuge unserer Prüfung erlangten Wissens und Verständnisses bezüglich der Gesellschaft und ihres Umfelds keine wesentlichen Falschangaben in den vorstehend angegebenen Informationen zur Kenntnis gelangt sind;

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

### Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

#### Überblick über den Umfang unseres Prüfberichts (Fortsetzung)

#### Prüfungsurteile zu sonstigen, im Companies Act 2014 vorgeschriebenen Angelegenheiten (Fortsetzung)

- auf der Grundlage der im Rahmen unserer Prüfung durchgeführten Arbeiten unserer Ansicht nach:
  - die Beschreibung der Hauptfunktionen der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme in Bezug auf den Prozess der Erstellung des Jahresabschlusses, und die Informationen über Stimmrechte und andere Angelegenheiten, die durch die Vorschriften der European Communities (Takeover Bids (Directive 2004/25/EC)) Regulations 2006 vorgeschrieben sind und durch den Companies Act von 2014 für unsere Berücksichtigung festgelegt sind, mit dem Abschluss übereinstimmen und gemäß dem Companies Act von 2014 erstellt wurden; und
  - die Corporate-Governance-Erklärung die vom Companies Act von 2014 vorgeschriebenen Angaben enthält.

#### Angelegenheiten, über die wir ausnahmsweise zu berichten haben

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

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

Die Börsenzulassungsregeln der Londoner Börse (London Stock Exchange) verlangen von uns die Überprüfung:

- der Erklärung des Verwaltungsrats auf den Seiten 47 bis 48 in Bezug auf die Unternehmensfortführung und längerfristige Wirtschaftlichkeit;
- des Teils der Corporate-Governance-Erklärung auf den Seiten 17 bis 47, der sich auf die Vorschriften des britischen Corporate Governance Code durch die Gesellschaft bezieht; und
- bestimmter Elemente der Angaben im Bericht an die Anteilhaber bezüglich der Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder;

Wir haben nichts zu berichten in Bezug auf Section 13 der irischen Verordnung European Union (Disclosure of Non-Financial and Diversity Information by certain large undertakings and groups) Regulations 2017 (in der jeweils geltenden Fassung), wonach wir verpflichtet sind, Sie zu informieren, wenn die Gesellschaft unserer Ansicht nicht die nach Section 5(2) bis (7) dieser Verordnung geforderten Informationen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 in der nichtfinanziellen Erklärung angegeben hat.

### Jeweilige Obliegenheiten

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

Wie in der Erklärung über die Obliegenheiten des Verwaltungsrates auf den Seiten 15 und 16 ausführlicher beschrieben, ist der Verwaltungsrat für die Erstellung des Jahresabschlusses verantwortlich und dafür, sich zu vergewissern, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt, sowie für die internen Kontrollen, die nach Maßgabe des Verwaltungsrats erforderlich sind, um die Aufstellung eines Abschlusses zu ermöglichen, der keine wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – Falschangaben aufgrund von Betrug oder Fehlern, enthält.



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

### Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)

#### Jeweilige Obliegenheiten (Fortsetzung)

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

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

##### Obliegenheiten des Abschlussprüfers in Bezug auf die Prüfung des Jahresabschlusses

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

Die Ziele unserer Prüfung in Bezug auf Verstöße sind: Identifizierung und Beurteilung der Risiken wesentlicher beabsichtigter Falschangaben im Jahresabschluss; Einholung hinreichender Prüfungsnachweise in Bezug auf die beurteilten Risiken einer wesentlichen beabsichtigten Falschangabe, indem wir angemessene Reaktionen darauf planen und durchführen; und angemessene Reaktionen auf Verstöße oder vermutete Verstöße, die während der Prüfung identifiziert wurden. Die Hauptverantwortung für die Verhinderung und Aufdeckung von Betrug liegt jedoch sowohl bei den bei der Gesellschaft für die Überwachung Verantwortlichen als auch beim Management.

Unsere Herangehensweise war wie folgt:

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

Weitere Beschreibungen unserer Obliegenheiten im Rahmen der Prüfung des Jahresabschlusses finden Sie auf der Webseite der IAASA unter [https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description\\_of\\_auditors\\_responsibilities\\_for\\_audit.pdf](https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf). Diese Beschreibung ist Teil unseres Berichts des Abschlussprüfers.

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

### **Bericht über die Abschlussprüfung (Fortsetzung)**

#### **Jeweilige Obliegenheiten (Fortsetzung)**

##### **Sonstige Angelegenheiten, zu denen wir Stellung nehmen müssen**

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

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

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

##### **Der Zweck unserer Prüfungstätigkeit und wem gegenüber wir verantwortlich sind**

Wir haben unsere Prüfungen vorgenommen, um die Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gegebenenfalls über die Sachverhalte zu informieren, über die wir sie in einem Prüfungsbericht zu informieren verpflichtet sind, und zu keinem anderen Zweck. Soweit im Rahmen der gesetzlichen Vorschriften zulässig, haften wir hinsichtlich unserer Prüfung, unseres Berichts oder der von uns gebildeten Meinungen lediglich gegenüber der Gesellschaft und ihren Gesellschaftern als Gremium.

**Kieran Daly**  
für und im Namen von  
**Ernst & Young Chartered Accountants and Statutory Audit Firm**

**Sitz: Dublin**

**Datum: 30. Oktober 2020**

## Bilanz der Gesellschaft

	Anm.	Zum 30. Juni 2020 Insgesamt \$	Zum 30. Juni 2019 Insgesamt \$
<b>Vermögenswerte</b>			
Bankguthaben	4	32.212.786	74.754.255
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	9.161.026	2.910.794
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet			
- Wertpapiere	12	3.880.020.736	2.319.197.879
- Geldmarktinstrumente	12	67.995.888	68.094.114
- Derivative Finanzinstrumente	12	16.587.925	11.424.591
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	904.185.086	1.007.764.308
Forderungen aus verkauften □Wertpapieren		21.027.161	-
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		2.982.273	-
Sonstige Vermögenswerte*		1.676.974	38.535.556
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>4.935.849.855</b>	<b>3.522.681.497</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>			
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet			
- Derivative Finanzinstrumente	12	(1.702.043)	(938.727)
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	(283.120)	(20.664)
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	(6.516.401)	(13.328.032)
Fällige gekaufte Wertpapiere		(19.275.269)	-
Fällige Kapitalbeteiligungen		(28.760.338)	-
Sonstige Verbindlichkeiten*		(2.139.126)	(99.225.878)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(58.676.297)</b>	<b>(113.513.301)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>4.877.173.558</b>	<b>3.409.168.196</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

\*Sonstige Vermögenswerte und sonstige Verbindlichkeiten setzten sich zum 30. Juni 2019 überwiegend aus Forderungen aus verkauften Wertpapieren/Kapitalanteilen bzw. Verbindlichkeiten aus gekauften Wertpapieren/Kapitalanteilen zusammen.

Verwaltungsratsmitglied

Verwaltungsratsmitglied

Genehmigungsdatum: 16. Oktober 2020

## Gesamtergebnisrechnung der Gesellschaft

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 Insgesamt \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 Insgesamt \$
<b>Erträge</b>			
Zinserträge		22.019	978.681
Dividendenerträge		59.451.482	27.842.701
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten*	2	1.151.183	-
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften*	2	13.746.987	-
Nettogewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	197.293.101	79.758.987
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>271.664.772</b>	<b>108.580.369</b>
<b>Aufwendungen</b>			
Verwaltungsgebühren	8	(21.003.913)	(20.540.004)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(72.892)	(79.372)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(21.076.805)</b>	<b>(20.619.376)</b>
<b>Nettoerträge</b>		<b>250.587.967</b>	<b>87.960.993</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>			
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	(1.564.170)	(18.098.374)
Zinsaufwand		(150.705)	(24.130)
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(1.714.875)</b>	<b>(18.122.504)</b>
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>248.873.092</b>	<b>69.838.489</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(8.446.136)	(4.492.570)
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor dem sonstigen Gesamtergebnis</b>		<b>240.426.956</b>	<b>65.345.919</b>
<b>Sonstiges Gesamtergebnis</b>			
Umrechnungsdifferenzen		(2.935.004)	-
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>237.491.952</b>	<b>65.345.919</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

\*Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten und Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften wurden im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 dem „Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ zugeordnet

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

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 Insgesamt \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 Insgesamt \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>3.409.168.196</b>	<b>3.707.569.928</b>
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit nach Steuern		237.491.952	65.345.919
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	2.758.872.000	1.257.630.432
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(1.528.358.590)	(1.617.288.070)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		1.230.513.410	(359.657.638)
Umrechnungsdifferenzen		-	(4.090.013)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>4.877.173.558</b>	<b>3.409.168.196</b>

## Kapitalflussrechnung der Gesellschaft

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 Insgesamt \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 Insgesamt \$
<b>Cashflows aus laufender Geschäftstätigkeit</b>			
Gewinn nach Steuern		240.426.956	65.345.919
<b>Berichtigung aufgrund von:</b>			
Zinserträgen		(22.019)	(978.681)
Zinsaufwand		150.705	24.130
Ausschüttung an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile		1.564.170	18.098.374
Dividendenerträge		(59.451.482)	(27.842.701)
Quellensteuern		8.446.136	4.492.570
		<b>191.114.466</b>	<b>59.139.611</b>
<b>(Zunahme)/Abnahme des Vermögens:</b>			
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten		(6.250.232)	6.865.717
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		(1.456.460.318)	266.553.971
Forderungen gegenüber Maklern		286.201	(286.201)
Sonstige Forderungen		50.746	289.101
<b>Zunahme/(Abnahme) der Verbindlichkeiten:</b>			
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten		(6.811.631)	6.206.471
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		(8.704.726)	11.207.952
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		(29.233)	(1.456.345)
Aufgelaufene Kosten		(1.286.229)	954.098
<b>Mittel(abfluss)/-zufluss aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(1.288.090.956)</b>	<b>349.474.375</b>
Zinsaufwand		(150.705)	(24.130)
Vereinnahmte Zinsen		178.734	6.267.900
Vereinnahmte Dividenden		50.358.506	22.945.849
<b>Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(1.237.704.421)</b>	<b>378.663.994</b>
<b>Mittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit</b>			
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile		(1.564.170)	(18.098.374)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen*	6	2.766.025.901	1.252.977.512
Rücknahmen rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile*	6	(1.566.626.231)	(1.554.613.270)
<b>Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit</b>		<b>1.197.835.500</b>	<b>(319.734.132)</b>
<b>Netto(abnahme)/-zunahme von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten</b>		<b>(39.868.921)</b>	<b>58.929.862</b>
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente am Anfang des Geschäftsjahres		74.733.591	19.893.742
Umrechnungsdifferenzen		(2.935.004)	(4.090.013)
<b>Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>31.929.666</b>	<b>74.733.591</b>

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

## Bilanz

Zum 30. Juni 2020

	Anm.	30. Juni 2020 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	30. Juni 2020 L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	30. Juni 2020 L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	30. Juni 2020 L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	30. Juni 2020 L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Bankguthaben	4	450.872	2.664.282	–	152	910.837	5	249
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	220.285	–	7.169.848	100.000	–	400.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	27.083.962	–	–	–	–	–	–
- Geldmarktinstrumente	12	–	1.416.838	4.918.341	25.761.829	187.493	1.942.759	3.026.326
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	176.861	–	1.951.562	–	526.945	284.054
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	27.985.328	63.846.403	404.461.433	11.616.000	23.686.751	45.160.750
Forderungen aus verkauften □Wertpapieren		–	–	–	–	–	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		–	–	3.858	20.587	–	–	3.926
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>27.534.834</b>	<b>32.463.594</b>	<b>68.768.602</b>	<b>439.365.411</b>	<b>12.814.330</b>	<b>26.156.460</b>	<b>48.875.305</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	(951.684)	–	(317.987)	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	(6.287)	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	(69.926)	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	–	–	–	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	(2.093.896)	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(17.823)	(15.408)	(38.498)	(121.865)	(8.634)	(13.078)	(18.700)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(17.823)</b>	<b>(2.109.304)</b>	<b>(996.469)</b>	<b>(121.865)</b>	<b>(326.621)</b>	<b>(83.004)</b>	<b>(18.700)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>27.517.011</b>	<b>30.354.290</b>	<b>67.772.133</b>	<b>439.243.546</b>	<b>12.487.709</b>	<b>26.073.456</b>	<b>48.856.605</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

	Anm.	30. Juni 2020 L&G Gold Mining UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Cyber Security UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G All Commodities UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>								
Bankguthaben	4	–	–	1.223.562	20.039.838	–	–	9.086
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	340.200	–	–	880.000	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	–	–	815.354.279	1.545.797.144	–	–	111.168.602
- Geldmarktinstrumente	12	24.932.004	428.239	–	–	3.554.208	545.656	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	13.355.572	–	–	–	113.694	33.305	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	242.098.799	12.558.700	–	–	45.918.070	7.224.553	–
Forderungen aus verkauften □Wertpapieren		–	13.068.700	7.564.400	–	–	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–	908.973
Sonstige Vermögenswerte		7.328	470	569.603	–	2.408	367	8.093
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>280.393.703</b>	<b>26.396.309</b>	<b>824.711.844</b>	<b>1.565.836.982</b>	<b>50.468.380</b>	<b>7.803.881</b>	<b>112.094.754</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	(240.235)	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	(1.546)	–	–	–	–	–	(274.513)
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	(6.430.000)	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	(12.558.700)	(2.480.839)	–	–	–	(509.569)
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	(5.095.500)	(17.140.476)	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(161.516)	(18.592)	(529.070)	(942.843)	(7.910)	(2.226)	(46.227)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(6.593.062)</b>	<b>(12.817.527)</b>	<b>(8.105.409)</b>	<b>(18.083.319)</b>	<b>(7.910)</b>	<b>(2.226)</b>	<b>(830.309)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>273.800.641</b>	<b>13.578.782</b>	<b>816.606.435</b>	<b>1.547.753.663</b>	<b>50.460.470</b>	<b>7.801.655</b>	<b>111.264.445</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.



**Bilanz (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2020

	Anm.	30. Juni 2020 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G US Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G UK Equity UCITS ETF £	30. Juni 2020 L&G Japan Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Global Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €
<b>Vermögenswerte</b>								
Bankguthaben	4	4.236.223	582.719	67.379	28.976	626.273	48.345	184.398
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Wertpapiere	12	25.583.106	58.904.923	137.130.983	10.908.960	116.113.301	32.474.303	99.611.089
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften <input type="checkbox"/> Wertpapieren		–	326.635	–	–	10.046	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	1.041.290	–	–
Sonstige Vermögenswerte		8.665	86.212	93.550	25.214	137.152	32.099	88.904
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>29.827.994</b>	<b>59.900.489</b>	<b>137.291.912</b>	<b>10.963.150</b>	<b>117.928.062</b>	<b>32.554.747</b>	<b>99.884.391</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	(890.091)	–	–	(1.449.132)	–	–
Fällige Kapitalbeteiligungen		(4.172.560)	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(11.522)	(22.597)	(5.604)	(455)	(9.559)	(2.668)	(8.132)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(4.184.082)</b>	<b>(912.688)</b>	<b>(5.604)</b>	<b>(455)</b>	<b>(1.458.691)</b>	<b>(2.668)</b>	<b>(8.132)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>25.643.912</b>	<b>58.987.801</b>	<b>137.286.308</b>	<b>10.962.695</b>	<b>116.469.371</b>	<b>32.552.079</b>	<b>99.876.259</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## Bilanz (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

	Anm.	30. Juni 2020 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Clean Water UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	30. Juni 2020 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup> €	30. Juni 2020 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>2</sup> \$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	4	11.587	31.519	133.568	13.239	61.187	308.658
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Wertpapiere	12	47.210.881	15.467.436	82.722.484	33.245.183	92.770.636	602.207.537
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften □Wertpapieren		57.380	–	–	–	–	–
Ausstehende Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	1.032.010
Sonstige Vermögenswerte		101.176	27.894	6.315	10.406	79.296	336.318
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>47.381.024</b>	<b>15.526.849</b>	<b>82.862.367</b>	<b>33.268.828</b>	<b>92.911.119</b>	<b>603.884.523</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–
Fällige gekaufte Wertpapiere		–	–	–	–	–	(1.386.938)
Fällige Kapitalbeteiligungen		–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(3.810)	(6.236)	(28.100)	(12.680)	(12.225)	(58.778)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(3.810)</b>	<b>(6.236)</b>	<b>(28.100)</b>	<b>(12.680)</b>	<b>(12.225)</b>	<b>(1.445.716)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>47.377.214</b>	<b>15.520.613</b>	<b>82.834.267</b>	<b>33.256.148</b>	<b>92.898.894</b>	<b>602.438.807</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup>Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.<sup>2</sup>Der 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 \$
<b>Vermögenswerte</b>								
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	12	23.928.786	–	–	–	–	–	–
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	43.868.974	431.248	975.133	2.126.977
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	228.795	–	3.674.727	10.627	–	121.008
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	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
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>24.233.370</b>	<b>36.579.450</b>	<b>69.395.922</b>	<b>602.326.549</b>	<b>6.128.799</b>	<b>14.344.885</b>	<b>49.175.016</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	(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)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(32.639)</b>	<b>(3.158.259)</b>	<b>(1.530.338)</b>	<b>(12.900.218)</b>	<b>(5.788)</b>	<b>(40.050)</b>	<b>(42.994)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>24.200.731</b>	<b>33.421.191</b>	<b>67.865.584</b>	<b>589.426.331</b>	<b>6.123.011</b>	<b>14.304.835</b>	<b>49.132.022</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## 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 <sup>2</sup> \$	30. Juni 2019 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	30. Juni 2019 L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> €	30. Juni 2019 L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> \$	30. Juni 2019 L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> \$	30. Juni 2019 L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> \$
<b>Vermögenswerte</b>								
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	12	–	–	931.605.800	–	–	–	–
- Geldmarktinstrumente	12	13.401.929	1.549.273	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	6.839.621	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	195.643.135	25.843.485	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		156.365	27.431.566	1.165.216	–	–	–	–
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>216.042.247</b>	<b>55.721.271</b>	<b>933.484.870</b>	<b>5.413.725</b>	<b>24.003.335</b>	<b>5.224.208</b>	<b>24.625.038</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	(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)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(5.180.557)</b>	<b>(26.270.509)</b>	<b>(1.201.558)</b>	<b>(5.413.725)</b>	<b>(24.003.335)</b>	<b>(5.224.208)</b>	<b>(24.625.038)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>210.861.690</b>	<b>29.450.762</b>	<b>932.283.312</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup> 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. Am 1. September 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für diese Fonds.

<sup>2</sup> 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 \$
<b>Vermögenswerte</b>								
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	12	911.625.932	-	-	46.988.976	7.841.435	4.712.300	112.408.028
- Geldmarktinstrumente	12	-	4.624.037	733.023	-	-	-	-
- Derivative Finanzinstrumente	12	-	342.712	172.451	-	-	-	-
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	-	48.713.000	7.893.000	-	-	-	-
Sonstige Vermögenswerte		5.159.213	19.426	2.143	33.929	4	4.653	80.731
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>918.787.820</b>	<b>53.699.196</b>	<b>9.002.548</b>	<b>47.126.664</b>	<b>7.856.651</b>	<b>4.724.985</b>	<b>112.736.829</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	-	-	-	-	-	-	-
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)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(1.180.164)</b>	<b>(672.227)</b>	<b>(205.849)</b>	<b>(52.333)</b>	<b>(9.028)</b>	<b>(4.714)</b>	<b>(8.832)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>917.607.656</b>	<b>53.026.969</b>	<b>8.796.699</b>	<b>47.074.331</b>	<b>7.847.623</b>	<b>4.720.271</b>	<b>112.727.997</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

**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 \$
<b>Vermögenswerte</b>								
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	12	9.606.775	93.180.252	28.130.997	100.128.524	26.517.762	2.019.176	1.972.857
- Geldmarktinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte		48.477	122.135	32.427	32.138	99.069	51	–
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>9.678.894</b>	<b>93.591.114</b>	<b>28.219.544</b>	<b>100.317.052</b>	<b>26.616.831</b>	<b>2.024.205</b>	<b>1.977.667</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet								
- Derivative Finanzinstrumente	12	–	–	–	–	–	–	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–	–	–	–	(20.063)	–	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(767)	(269.035)	(15.690)	(23.092)	(4.118)	(107)	(78)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(767)</b>	<b>(269.035)</b>	<b>(15.690)</b>	<b>(23.092)</b>	<b>(24.181)</b>	<b>(107)</b>	<b>(78)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>9.678.127</b>	<b>93.322.079</b>	<b>28.203.854</b>	<b>100.293.960</b>	<b>26.592.650</b>	<b>2.024.098</b>	<b>1.977.589</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

**Bilanz (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2019

	Anm.	30. Juni 2019 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$
<b>Vermögenswerte</b>		
Bankguthaben	4	4.926
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	5	–
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		
- Wertpapiere	12	2.014.722
- Geldmarktinstrumente	12	–
- Derivative Finanzinstrumente	12	–
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5,12	–
Sonstige Vermögenswerte		77
<b>Gesamtvermögenswerte</b>		<b>2.019.725</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>		
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet		
- Derivative Finanzinstrumente	12	–
Kontokorrentverbindlichkeiten	4	–
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	5	–
Sonstige Verbindlichkeiten		(79)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>		<b>(79)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>2.019.646</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		1.369	–	–	3.418	58	336	1.900
Dividendenerträge		460.640	–	–	–	–	–	–
Zinserträge aus Schultiteln und Geldmarktinstrumenten		–	(177)	147	658.439	3.532	6.472	67.780
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	(112.798)	(301.201)	8.506.720	44.339	80.685	776.799
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	2.450.810	7.762.591	(262.138)	(95.836.009)	(1.615.989)	(1.158.831)	(1.997.513)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>2.912.819</b>	<b>7.649.616</b>	<b>(563.192)</b>	<b>(86.667.432)</b>	<b>(1.568.060)</b>	<b>(1.071.338)</b>	<b>(1.151.034)</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(216.473)	(112.361)	(453.756)	(1.601.939)	(46.630)	(109.647)	(236.691)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		–	(4.160)	(5.135)	(6.467)	(2.321)	(3.351)	(3.713)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(216.473)</b>	<b>(116.521)</b>	<b>(458.891)</b>	<b>(1.608.406)</b>	<b>(48.951)</b>	<b>(112.998)</b>	<b>(240.404)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>2.696.346</b>	<b>7.533.095</b>	<b>(1.022.083)</b>	<b>(88.275.838)</b>	<b>(1.617.011)</b>	<b>(1.184.336)</b>	<b>(1.391.438)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(27)	(7.912)	(19.432)	(57.751)	(308)	(498)	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(27)</b>	<b>(7.912)</b>	<b>(19.432)</b>	<b>(57.751)</b>	<b>(308)</b>	<b>(498)</b>	<b>–</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>2.696.319</b>	<b>7.525.183</b>	<b>(1.041.515)</b>	<b>(88.333.589)</b>	<b>(1.617.319)</b>	<b>(1.184.834)</b>	<b>(1.391.438)</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(46.534)	–	–	–	–	–	–
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>2.649.785</b>	<b>7.525.183</b>	<b>(1.041.515)</b>	<b>(88.333.589)</b>	<b>(1.617.319)</b>	<b>(1.184.834)</b>	<b>(1.391.438)</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.



## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Gold Mining UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G ROBO Global@ Robotics and Automation UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Cyber Security UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		3.869	380	2.626	5.930	94	24	416
Dividendenerträge		–	–	9.249.965	29.320.972	–	–	944.621
Zinserträge aus Schultiteln und Geldmarktinstrumenten		304.609	30.504	–	–	66.835	10.447	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		3.501.388	315.742	–	–	814.855	131.714	–
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	64.968.077	(9.595.576)	63.198.401	226.167.983	(10.967.918)	(1.110.438)	7.279.728
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>68.777.943</b>	<b>(9.248.950)</b>	<b>72.450.992</b>	<b>255.494.885</b>	<b>(10.086.134)</b>	<b>(968.253)</b>	<b>8.224.765</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(1.603.260)	(48.195)	(6.590.742)	(8.232.632)	(79.810)	(25.271)	(299.717)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(6.448)	(3.186)	(4.249)	(3.570)	(2.967)	(1.199)	(627)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(1.609.708)</b>	<b>(51.381)</b>	<b>(6.594.991)</b>	<b>(8.236.202)</b>	<b>(82.777)</b>	<b>(26.470)</b>	<b>(300.344)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>67.168.235</b>	<b>(9.300.331)</b>	<b>65.856.001</b>	<b>247.258.683</b>	<b>(10.168.911)</b>	<b>(994.723)</b>	<b>7.924.421</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	(1.564.170)	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(1.298)	(210)	(16.849)	(36.175)	(856)	(321)	(1.997)
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(1.298)</b>	<b>(1.564.380)</b>	<b>(16.849)</b>	<b>(36.175)</b>	<b>(856)</b>	<b>(321)</b>	<b>(1.997)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>67.166.937</b>	<b>(10.864.711)</b>	<b>65.839.152</b>	<b>247.222.508</b>	<b>(10.169.767)</b>	<b>(995.044)</b>	<b>7.922.424</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(113.125)	–	(1.479.508)	(4.181.252)	–	–	(145.801)
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>67.053.812</b>	<b>(10.864.711)</b>	<b>64.359.644</b>	<b>243.041.256</b>	<b>(10.169.767)</b>	<b>(995.044)</b>	<b>7.776.623</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G US Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G UK Equity UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Global Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		112	42	465	19	203	243	6
Dividendenerträge		86.434	258.068	2.514.178	362.111	2.720.925	683.152	2.182.147
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	–	–	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	3.185.005	5.549.057	6.201.840	(1.677.471)	852.380	165.161	(1.232.417)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>3.271.551</b>	<b>5.807.167</b>	<b>8.716.483</b>	<b>(1.315.341)</b>	<b>3.573.508</b>	<b>848.556</b>	<b>949.736</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(57.802)	(66.416)	(64.067)	(4.865)	(109.077)	(30.075)	(97.796)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(1.030)	(543)	(2.427)	(368)	(845)	(2.046)	(2.377)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(58.832)</b>	<b>(66.959)</b>	<b>(66.494)</b>	<b>(5.233)</b>	<b>(109.922)</b>	<b>(32.121)</b>	<b>(100.173)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>3.212.719</b>	<b>5.740.208</b>	<b>8.649.989</b>	<b>(1.320.574)</b>	<b>3.463.586</b>	<b>816.435</b>	<b>849.563</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(164)	(806)	(480)	(14)	(171)	(26)	(778)
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(164)</b>	<b>(806)</b>	<b>(480)</b>	<b>(14)</b>	<b>(171)</b>	<b>(26)</b>	<b>(778)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>3.212.555</b>	<b>5.739.402</b>	<b>8.649.509</b>	<b>(1.320.588)</b>	<b>3.463.415</b>	<b>816.409</b>	<b>848.785</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(11.501)	(29.932)	(352.481)	(5.264)	(408.201)	(85.954)	(309.479)
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>3.201.054</b>	<b>5.709.470</b>	<b>8.297.028</b>	<b>(1.325.852)</b>	<b>3.055.214</b>	<b>730.455</b>	<b>539.306</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Clean Water UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup> €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>2</sup> \$
<b>Erträge</b>							
Zinserträge		154	22	37	60	9	118
Dividenerträge		1.204.406	133.993	43.190	36.067	2.552.256	6.110.563
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten		–	–	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften		–	–	–	–	–	–
Netto(verlust)/-gewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	(4.359.564)	(777.473)	6.306.793	3.469.184	(31.476.619)	(34.454.643)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>(3.155.004)</b>	<b>(643.458)</b>	<b>6.350.020</b>	<b>3.505.311</b>	<b>(28.924.354)</b>	<b>(28.343.962)</b>
<b>Aufwendungen</b>							
Verwaltungsgebühren	8	(34.352)	(31.870)	(50.530)	(42.968)	(222.758)	(399.265)
Spesen im Zusammenhang mit der Verwahrung		(2.340)	(1.404)	(941)	(952)	(4.485)	(2.477)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(36.692)</b>	<b>(33.274)</b>	<b>(51.471)</b>	<b>(43.920)</b>	<b>(227.243)</b>	<b>(401.742)</b>
<b>Nettoaufwendungen/-erträge</b>		<b>(3.191.696)</b>	<b>(676.732)</b>	<b>6.298.549</b>	<b>3.461.391</b>	<b>(29.151.597)</b>	<b>(28.745.704)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>							
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(388)	(58)	(20)	(109)	(570)	(245)
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(388)</b>	<b>(58)</b>	<b>(20)</b>	<b>(109)</b>	<b>(570)</b>	<b>(245)</b>
<b>(Abnahme)/Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>(3.192.084)</b>	<b>(676.790)</b>	<b>6.298.529</b>	<b>3.461.282</b>	<b>(29.152.167)</b>	<b>(28.745.949)</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(18.573)	(19.405)	(4.893)	(5.935)	(295.059)	(868.749)
<b>(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>(3.210.657)</b>	<b>(696.195)</b>	<b>6.293.636</b>	<b>3.455.347</b>	<b>(29.447.226)</b>	<b>(29.614.698)</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup>Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

<sup>2</sup>Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

## Gesamtergebnisrechnung

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		1.930	–	–	878.093	–	12	–
Dividendenerträge		445.928	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	1.035.371	1.630.136	(4.199.691)	(55.399.821)	(17.515)	(461.336)	(2.669.680)
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>1.483.229</b>	<b>1.630.136</b>	<b>(4.199.691)</b>	<b>(54.521.728)</b>	<b>(17.515)</b>	<b>(461.324)</b>	<b>(2.669.680)</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(177.161)	(134.807)	(421.516)	(1.967.881)	(34.856)	(90.161)	(226.563)
Sonstige Kosten		(4.700)	(3.371)	(4.482)	(7.340)	(2.157)	(2.786)	(2.999)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(181.861)</b>	<b>(138.178)</b>	<b>(425.998)</b>	<b>(1.975.221)</b>	<b>(37.013)</b>	<b>(92.947)</b>	<b>(229.562)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>1.301.368</b>	<b>1.491.958</b>	<b>(4.625.689)</b>	<b>(56.496.949)</b>	<b>(54.528)</b>	<b>(554.271)</b>	<b>(2.899.242)</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		–	(1.839)	(3.412)	–	(253)	–	(1.094)
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>–</b>	<b>(1.839)</b>	<b>(3.412)</b>	<b>–</b>	<b>(253)</b>	<b>–</b>	<b>(1.094)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>1.301.368</b>	<b>1.490.119</b>	<b>(4.629.101)</b>	<b>(56.496.949)</b>	<b>(54.781)</b>	<b>(554.271)</b>	<b>(2.900.336)</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(44.865)	–	–	–	–	–	–
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>1.256.503</b>	<b>1.490.119</b>	<b>(4.629.101)</b>	<b>(56.496.949)</b>	<b>(54.781)</b>	<b>(554.271)</b>	<b>(2.900.336)</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Gold Mining UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G ROBO Global@ Robotics and Automation UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		–	–	7.117	–	4.510	5.859	–
Dividendenerträge		–	–	13.554.599	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	41.286.401	949.692	(25.195.346)	448.229	2.067.312	(929.368)	3.598.478
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>41.286.401</b>	<b>949.692</b>	<b>(11.633.630)</b>	<b>448.229</b>	<b>2.071.822</b>	<b>(923.509)</b>	<b>3.598.478</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(1.180.760)	(73.051)	(8.453.836)	(37.602)	(288.322)	(73.454)	(974.784)
Sonstige Kosten		(5.244)	(3.842)	(2.663)	(561)	(1.133)	(7.992)	(18.375)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(1.186.004)</b>	<b>(76.893)</b>	<b>(8.456.499)</b>	<b>(38.163)</b>	<b>(289.455)</b>	<b>(81.446)</b>	<b>(993.159)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>40.100.397</b>	<b>872.799</b>	<b>(20.090.129)</b>	<b>410.066</b>	<b>1.782.367</b>	<b>(1.004.955)</b>	<b>2.605.319</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	(2.168.116)	–	(136.814)	(2.343.199)	(153.406)	(13.277.586)
Zinsaufwand		(38)	(413)	–	(4.037)	–	–	(6.450)
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(38)</b>	<b>(2.168.529)</b>	<b>–</b>	<b>(140.851)</b>	<b>(2.343.199)</b>	<b>(153.406)</b>	<b>(13.284.036)</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>40.100.359</b>	<b>(1.295.730)</b>	<b>(20.090.129)</b>	<b>269.215</b>	<b>(560.832)</b>	<b>(1.158.361)</b>	<b>(10.678.717)</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(153.977)	–	(2.107.896)	1.040	6.283	(5.372)	(279.623)
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>39.946.382</b>	<b>(1.295.730)</b>	<b>(22.198.025)</b>	<b>270.255</b>	<b>(554.549)</b>	<b>(1.163.733)</b>	<b>(10.958.340)</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup> 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. Am 1. September 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für diese Fonds.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G Cyber Security UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G US Equity UCITS ETF <sup>1</sup> \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		–	77.653	146	–	21	–	253
Dividendenerträge		4.502.909	–	–	790.264	39.053	61.968	840.117
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	100.113.543	(2.532.403)	(2.249.409)	(2.137.928)	(376.955)	(94.624)	6.998.983
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>104.616.452</b>	<b>(2.454.750)</b>	<b>(2.249.263)</b>	<b>(1.347.664)</b>	<b>(337.881)</b>	<b>(32.656)</b>	<b>7.839.353</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(5.697.800)	(69.103)	(34.618)	(242.516)	(50.440)	(26.549)	(20.419)
Sonstige Kosten		(1.376)	(3.284)	(1.620)	(262)	(288)	(369)	(36)
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(5.699.176)</b>	<b>(72.387)</b>	<b>(36.238)</b>	<b>(242.778)</b>	<b>(50.728)</b>	<b>(26.918)</b>	<b>(20.455)</b>
<b>Nettoerträge/(-aufwendungen)</b>		<b>98.917.276</b>	<b>(2.527.137)</b>	<b>(2.285.501)</b>	<b>(1.590.442)</b>	<b>(388.609)</b>	<b>(59.574)</b>	<b>7.818.898</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(3.864)	–	–	(110)	–	(3)	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(3.864)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(110)</b>	<b>–</b>	<b>(3)</b>	<b>–</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>98.913.412</b>	<b>(2.527.137)</b>	<b>(2.285.501)</b>	<b>(1.590.552)</b>	<b>(388.609)</b>	<b>(59.577)</b>	<b>7.818.898</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(527.652)	–	–	(150.344)	(9.080)	(8.661)	(124.191)
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>98.385.760</b>	<b>(2.527.137)</b>	<b>(2.285.501)</b>	<b>(1.740.896)</b>	<b>(397.689)</b>	<b>(68.238)</b>	<b>7.694.707</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 7. November 2018 aufgelegt.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019

	Anm.	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G UK Equity UCITS ETF <sup>1</sup> £	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G Japan Equity UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G Global Equity UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF <sup>1</sup> €	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Berichtszeitraum vom 25. Juni 2019 bis zum 30. Juni 2019 L&G Clean Water UCITS ETF <sup>2</sup> \$	Berichtszeitraum vom 26. Juni 2019 bis zum 30. Juni 2019 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF <sup>3</sup> \$
<b>Erträge</b>								
Zinserträge		–	2.613	421	–	49	–	–
Dividendenerträge		288.412	1.163.380	427.082	4.542.291	507.255	60	–
Nettogewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	489.650	1.163.701	1.443.489	11.833.974	1.585.762	29.794	44.547
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>778.062</b>	<b>2.329.694</b>	<b>1.870.992</b>	<b>16.376.265</b>	<b>2.093.066</b>	<b>29.854</b>	<b>44.547</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Verwaltungsgebühren	8	(2.579)	(37.234)	(13.894)	(69.357)	(10.268)	(107)	(78)
Sonstige Kosten		(186)	(130)	(318)	(495)	(606)	–	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(2.765)</b>	<b>(37.364)</b>	<b>(14.212)</b>	<b>(69.852)</b>	<b>(10.874)</b>	<b>(107)</b>	<b>(78)</b>
<b>Nettoerträge</b>		<b>775.297</b>	<b>2.292.330</b>	<b>1.856.780</b>	<b>16.306.413</b>	<b>2.082.192</b>	<b>29.747</b>	<b>44.469</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>								
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwand		(29)	–	–	(1.059)	–	–	–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>(29)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1.059)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>775.268</b>	<b>2.292.330</b>	<b>1.856.780</b>	<b>16.305.354</b>	<b>2.082.192</b>	<b>29.747</b>	<b>44.469</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(2.951)	(174.531)	(54.576)	(748.119)	(9.202)	(9)	–
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>772.317</b>	<b>2.117.799</b>	<b>1.802.204</b>	<b>15.557.235</b>	<b>2.072.990</b>	<b>29.738</b>	<b>44.469</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 7. November 2018 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 25. Juni 2019 aufgelegt.

<sup>3</sup> Der Fonds wurde am 26. Juni 2019 aufgelegt.

## Gesamtergebnisrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019

	Anm.	Berichtszeitraum vom 26. Juni 2019 bis zum 30. Juni 2019  L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF <sup>1</sup> \$
<b>Erträge</b>		
Zinserträge		–
Dividenderträge		93
Nettogewinn aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2	49.468
<b>Erträge insgesamt</b>		<b>49.561</b>
<b>Aufwendungen</b>		
Verwaltungsgebühren	8	(82)
Sonstige Kosten		–
<b>Gesamtaufwendungen</b>		<b>(82)</b>
<b>Nettoerträge</b>		<b>49.479</b>
<b>Finanzaufwendungen</b>		
Auf rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile ausgezahlte Ausschüttungen	14	–
Zinsaufwand		–
<b>Finanzaufwendungen insgesamt</b>		<b>–</b>
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit vor Steuern</b>		<b>49.479</b>
Quellensteuer auf Dividenden		(13)
<b>Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit</b>		<b>49.466</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup>Der Fonds wurde am 26. Juni 2019 aufgelegt.



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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>24.200.731</b>	<b>33.421.191</b>	<b>67.865.584</b>	<b>589.426.331</b>	<b>6.123.011</b>	<b>14.304.835</b>	<b>49.132.022</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		2.649.785	7.525.183	(1.041.515)	(88.333.589)	(1.617.319)	(1.184.834)	(1.391.438)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	5.903.440	60.114.725	88.895.476	270.458.935	26.367.659	49.368.329	18.413.357
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(5.236.945)	(70.706.809)	(87.947.412)	(332.308.131)	(18.385.642)	(36.414.874)	(17.297.336)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		666.495	(10.592.084)	948.064	(61.849.196)	7.982.017	12.953.455	1.116.021
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>27.517.011</b>	<b>30.354.290</b>	<b>67.772.133</b>	<b>439.243.546</b>	<b>12.487.709</b>	<b>26.073.456</b>	<b>48.856.605</b>

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G Gold Mining UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G Cyber Security UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020  L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>210.861.690</b>	<b>29.450.762</b>	<b>932.283.312</b>	<b>917.607.656</b>	<b>53.026.969</b>	<b>8.796.699</b>	<b>47.074.331</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		67.053.812	(10.864.711)	64.359.644	243.041.256	(10.169.767)	(995.044)	7.776.623
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	121.119.834	7.760.906	46.365.660	530.816.225	10.012.966	–	91.218.870
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(125.234.695)	(12.768.175)	(226.402.181)	(143.711.474)	(2.409.698)	–	(34.805.379)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		(4.114.861)	(5.007.269)	(180.036.521)	387.104.751	7.603.268	–	56.413.491
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>273.800.641</b>	<b>13.578.782</b>	<b>816.606.435</b>	<b>1.547.753.663</b>	<b>50.460.470</b>	<b>7.801.655</b>	<b>111.264.445</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G US Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G UK Equity UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Global Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>7.847.623</b>	<b>4.720.271</b>	<b>112.727.997</b>	<b>9.678.127</b>	<b>93.322.079</b>	<b>28.203.854</b>	<b>100.293.960</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		3.201.054	5.709.470	8.297.028	(1.325.852)	3.055.214	730.455	539.306
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	21.011.745	50.057.260	24.982.990	2.610.420	35.425.154	4.429.230	7.297.536
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(6.416.510)	(1.499.200)	(8.721.707)	–	(15.333.076)	(811.460)	(8.254.543)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		14.595.235	48.558.060	16.261.283	2.610.420	20.092.078	3.617.770	(957.007)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>25.643.912</b>	<b>58.987.801</b>	<b>137.286.308</b>	<b>10.962.695</b>	<b>116.469.371</b>	<b>32.552.079</b>	<b>99.876.259</b>

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Clean Water UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup> €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>2</sup> \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>26.592.650</b>	<b>2.024.098</b>	<b>1.977.589</b>	<b>2.019.646</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
(Abnahme)/ Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(3.210.657)	(696.195)	6.293.636	3.455.347	(29.447.226)	(29.614.698)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	23.995.221	14.192.710	74.979.222	27.781.155	212.784.420	873.702.935
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	–	–	(416.180)	–	(90.438.300)	(241.649.430)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		23.995.221	14.192.710	74.563.042	27.781.155	122.346.120	632.053.505
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>47.377.214</b>	<b>15.520.613</b>	<b>82.834.267</b>	<b>33.256.148</b>	<b>92.898.894</b>	<b>602.438.807</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup>Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

<sup>2</sup>Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF £	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>20.352.408</b>	<b>33.130.560</b>	<b>78.174.952</b>	<b>882.075.669</b>	<b>7.068.884</b>	<b>18.633.818</b>	<b>54.250.917</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		1.256.503	1.490.119	(4.629.101)	(56.496.949)	(54.781)	(554.271)	(2.900.336)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	5.498.240	24.929.507	52.028.297	177.030.407	10.388.091	11.625.700	13.469.306
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(2.906.420)	(26.128.995)	(57.708.564)	(413.182.796)	(11.279.183)	(15.400.412)	(15.687.865)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		2.591.820	(1.199.488)	(5.680.267)	(236.152.389)	(891.092)	(3.774.712)	(2.218.559)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>24.200.731</b>	<b>33.421.191</b>	<b>67.865.584</b>	<b>589.426.331</b>	<b>6.123.011</b>	<b>14.304.835</b>	<b>49.132.022</b>

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Gold Mining UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup> \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>191.506.566</b>	<b>30.119.528</b>	<b>1.202.590.627</b>	<b>14.700.397</b>	<b>112.684.582</b>	<b>40.346.635</b>	<b>256.845.384</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		39.946.382	(1.295.730)	(22.198.025)	270.255	(554.549)	(1.163.733)	(10.958.340)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	30.306.573	14.294.174	9.459.580	–	28.965.524	2.205.495	25.661.295
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(50.897.831)	(13.667.210)	(257.568.870)	(14.970.652)	(141.095.557)	(41.388.397)	(271.548.339)
Netto(abnahme)/-zunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		(20.591.258)	626.964	(248.109.290)	(14.970.652)	(112.130.033)	(39.182.902)	(245.887.044)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>210.861.690</b>	<b>29.450.762</b>	<b>932.283.312</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup> 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. Am 1. September 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für diese Fonds.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019

	Anm.	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Cyber Security UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Battery Value- Chain UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019  L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019  L&G US Equity UCITS ETF <sup>1</sup> \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>642.041.827</b>	<b>21.786.295</b>	<b>38.235.287</b>	<b>27.792.947</b>	<b>2.972.122</b>	<b>2.912.169</b>	<b>–</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		98.385.760	(2.527.137)	(2.285.501)	(1.740.896)	(397.689)	(68.238)	7.694.707
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	314.424.312	38.912.436	294.278	24.477.920	7.714.665	1.876.340	105.033.290
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	(137.244.243)	(5.144.625)	(27.447.365)	(3.455.640)	(2.441.475)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		177.180.069	33.767.811	(27.153.087)	21.022.280	5.273.190	1.876.340	105.033.290
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>917.607.656</b>	<b>53.026.969</b>	<b>8.796.699</b>	<b>47.074.331</b>	<b>7.847.623</b>	<b>4.720.271</b>	<b>112.727.997</b>

	Anm.	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019  L&G UK Equity UCITS ETF <sup>1</sup> £	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019  L&G Japan Equity UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019  L&G Global Equity UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019  L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF <sup>1</sup> €	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019  L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF <sup>1</sup> \$	Berichtszeitraum vom 25. Juni 2019 bis zum 30. Juni 2019  L&G Clean Water UCITS ETF <sup>2</sup> \$	Berichtszeitraum vom 26. Juni 2019 bis zum 30. Juni 2019  L&G Artificial Intelligence UCITS ETF <sup>3</sup> \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		772.317	2.117.799	1.802.204	15.557.235	2.072.990	29.738	44.469
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	8.905.810	91.204.280	26.401.650	161.091.525	24.519.660	1.994.360	1.933.120
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	–	–	–	(76.354.800)	–	–	–
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		8.905.810	91.204.280	26.401.650	84.736.725	24.519.660	1.994.360	1.933.120
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>9.678.127</b>	<b>93.322.079</b>	<b>28.203.854</b>	<b>100.293.960</b>	<b>26.592.650</b>	<b>2.024.098</b>	<b>1.977.589</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 7. November 2018 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 25. Juni 2019 aufgelegt.

<sup>3</sup> Der Fonds wurde am 26. Juni 2019 aufgelegt.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019

	Anm.	Berichtszeitraum vom 26. Juni 2019 bis zum 30. Juni 2019  L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF <sup>1</sup> \$
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>		–
Zunahme des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		49.466
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	6	1.970.180
Wert der zurückgenommenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile	6	–
Nettozunahme des Nettovermögens aus Geschäften mit Anteilen		1.970.180
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>2.019.646</b>

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 26. Juni 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

##### A. Grundlagen der Erstellung

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

Der Abschluss wurde unter der Annahme der Unternehmensfortführung (Going-Concern-Prinzip) erstellt, d. h. es wird davon ausgegangen, dass die Gesellschaft auf absehbare Zeit ihren Geschäftsbetrieb fortführen wird. Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die erfolgswirksame Neubewertung eines beträchtlichen Anteils der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert. Die wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze werden nachstehend beschrieben.

Legal & General UCITS ETF Plc ist das berichtende Unternehmen, und die einzelnen Fonds sind Segmente. Der Abschluss der Gesellschaft auf den Seiten 66 bis 69 stellt die Summe der einzelnen Segmente dar, umgerechnet gemäß Anmerkung 1(H).

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

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

Es wurden bestimmte Änderungen in der Klassifizierung von Salden im aktuellen Jahr vorgenommen. Die Vergleichszahlen wurden nicht in Bezug auf diese Klassifizierungsänderungen angepasst. Diese Umklassifizierungen haben keine Auswirkung auf die Finanzergebnisse für die dargestellten Geschäftsjahre.

##### Einsatz von Schätzungen und Beurteilungen

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

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

##### Annahmen und Schätzungsunsicherheiten

Angaben zu Annahmen und Schätzungsunsicherheiten, aufgrund derer ein Risiko besteht, dass in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 wesentliche Anpassungen an den Buchwerten von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten vorgenommen werden müssen, sind Anmerkung 12.4. („Zeitwert“) *enthalten und beziehen sich auf die Bestimmung des Zeitwerts von Finanzinstrumenten mit wesentlichen nicht beobachtbaren Parametern.*

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

#### **Neue Standards, Änderungen und Auslegungen mit Wirkung für das Geschäftsjahr ab dem 1. Juli 2019**

- **Änderungen an IFRS 9: Merkmale vorzeitiger Rückzahlung mit negativer Vergütung**

Durch die im IFRS 9 „Finanzinstrumente“ im Dezember 2017 erfolgten Änderungen, die für am oder nach dem 1. Januar 2019 beginnende Geschäftsjahre wirksam sind, wobei eine vorzeitige Anwendung zulässig ist, ermöglichen es Unternehmen, bestimmte vorzeitig rückzahlbare finanzielle Vermögenswerte mit negativer Vergütung zu fortgeführten Anschaffungskosten zu bewerten.

Diese Vermögenswerte, die einige Darlehenssicherheiten und Schuldtitel beinhalten, würden ansonsten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden müssen. Um unter die Bewertung zu fortgeführten Anschaffungskosten zu fallen, muss die negative Vergütung „eine angemessene Vergütung für eine vorzeitige Kündigung des Kontrakts“ sein, und der Vermögenswert muss in einem Geschäftsmodell „Halten bis zur Vereinnahmung vertraglicher Zahlungsströme“ gehalten werden.

Die Übernahme der Änderungen im IFRS 9 hatte keine wesentliche Auswirkung auf den Abschluss der Gesellschaft.

- **International Financial Reporting Interpretations Committee („IFRIC“) 23, Bilanzierung von Unsicherheit in Bezug auf Ertragssteuern**

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 hatte keine wesentlichen Auswirkungen auf den Jahresabschluss der Gesellschaft.

#### **Neue Standards, Änderungen und Auslegungen, die herausgegeben, aber für das Geschäftsjahr ab dem 1. Juli 2019 noch nicht in Kraft getreten waren und nicht frühzeitig angewendet wurden**

- **Änderungen an den International Accounting Standards („IAS“) 1 und 8**

Der International Accounting Standards Board („IASB“) hat Änderungen im IAS 1 „Darstellung des Abschlusses“ und IAS 8 „Bilanzierungsgrundsätze, Änderungen von Schätzungen und Fehlern in der Rechnungslegung“ vorgenommen, die eine einheitliche Definition von Wesentlichkeit in allen International Financial Reporting Standards und im Rahmenkonzept für die Rechnungslegung verwenden. klarstellen, wann Informationen wesentlich sind und teilweise die Leitlinien in IAS 1 über unwesentliche Informationen berücksichtigen.

Die Änderungen stellen insbesondere klar:

- dass die Bezugnahme auf verschleiende Informationen sich auf Situationen bezieht, in denen die Auswirkung einer Auslassung oder Falschangabe dieser Informationen gleichkommt, und dass ein Unternehmen die Wesentlichkeit im Zusammenhang mit dem Abschluss als Ganzes beurteilt, und

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

#### **Neue Standards, Änderungen und Auslegungen, die herausgegeben, aber für das Geschäftsjahr ab dem 1. Juli 2019 noch nicht in Kraft getreten waren und nicht frühzeitig angewendet wurden (Fortsetzung)**

- die Bedeutung „primärer Abschlussadressaten“, auf die dieser Abschluss abgestellt ist, indem sie als „bestehende und potenzielle Investoren, Kreditgeber und sonstige Gläubiger“ definiert werden, die für die von ihnen benötigten Informationen mehrheitlich auf die in den Abschlüssen gegebenen Informationen zurückgreifen müssen.

Die Änderung ist wirksam für am oder nach dem 1. Januar 2020 beginnende Berichtsjahre. Auf Basis der vorläufigen Beurteilung hat dieser neue Standard keine wesentlichen Auswirkungen auf den Abschluss der Gesellschaft.

- **Überarbeitetes Rahmenkonzept für die Rechnungslegung**

Der IASB hat ein überarbeitetes Rahmenkonzept veröffentlicht, das mit sofortiger Wirkung in standardsetzenden Entscheidungen Anwendung findet. Zu den wichtigsten Änderungen gehören:

- Steigerung der Bedeutung von Verantwortung im Ziel der Rechnungslegung
- Wiedereinsetzung von Sorgfalt als Komponente der Neutralität
- Definition eines berichtenden Unternehmens, wobei es sich um ein Rechtssubjekt oder einen Bereich eines Unternehmens handeln kann
- Änderung der Definitionen von einem Vermögenswert und einer Verbindlichkeit
- Streichung der Wahrscheinlichkeitsschwelle für die Erfassung und Aufnahme von Leitlinien in Bezug auf die Ausbuchung
- Aufnahme von Leitlinien in Bezug auf verschiedene Bewertungsgrundlagen
- die Angabe, dass der Gewinn oder Verlust der primäre Leistungsindikator ist, und dass Erträge und Aufwendungen im sonstigen Gesamtergebnis grundsätzlich zurückgeführt werden sollten, wenn dies die Bedeutung oder wirklichkeitstgetreue Darstellung des Abschlusses verbessert.

Es erfolgen keine Änderungen an einem der aktuellen Bilanzierungsgrundsätze. Unternehmen, die sich bei der Festlegung ihrer Bilanzierungsgrundsätze für Transaktionen, Ereignisse oder Bedingungen, die nicht anderweitig im Rahmen der Bilanzierungspolitik behandelt werden, auf das Rahmenkonzept stützen, müssen das überarbeitete Rahmenkonzept ab dem 1. Januar 2020 anwenden. Diese Unternehmen müssen abwägen, ob ihre Bilanzierungsgrundsätze nach dem überarbeiteten Rahmen immer noch angemessen sind.

Die Änderung ist wirksam für am oder nach dem 1. Januar 2020 beginnende Berichtsjahre. Auf Basis der vorläufigen Beurteilung sind die Bilanzierungsgrundsätze der Gesellschaft nach dem überarbeiteten Rahmen immer noch angemessen.

##### B. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

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

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



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

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

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

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

Alle sonstigen finanziellen Vermögenswerte der Gesellschaft werden erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

##### Beurteilung des Geschäftsmodells

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

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

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

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

- Ein auf dem Halten zur Vereinnahmung beruhendes Geschäftsmodell: Darunter fallen Bankguthaben, Kassenbestände für Margenforderungen an Kontrahenten und sonstige Vermögenswerte. Diese finanziellen Vermögenswerte werden gehalten, um daraus vertragliche Zahlungsströme zu vereinnahmen.
- Das sonstige Geschäftsmodell: Darunter fallen Schuldtitel, Aktienanlagen, umgekehrte Pensionsgeschäfte, derivative Finanzinstrumente und Geldmarktinstrumente. Diese finanziellen Vermögenswerte werden auf Zeitwertbasis gehalten und ihre Performance wird entsprechend bewertet, wobei es häufig zu Veräußerungen kommt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

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

##### **Umklassifizierungen**

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

##### **(ii) Wertminderung finanzieller Vermögenswerte**

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

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

##### **Bewertung erwarteter Kreditverluste**

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

##### **Finanzielle Vermögenswerte mit objektivem Hinweis auf Wertminderung durch Kreditausfälle**

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

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

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

##### **Ausweis der Risikovorsorge für erwartete Kreditverluste in der Bilanz**

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

##### **Abschreibung**

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

###### (iii) Ausbuchung

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

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

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

Der ‚beizulegenden Zeitwert‘ ist der Preis, der in einer geordneten Transaktion zwischen Marktteilnehmern zum Bewertungsdatum auf dem Hauptmarkt oder andernfalls auf dem günstigsten Markt, zu dem die Gesellschaft zu diesem Zeitpunkt Zugang hat, bei einem Verkauf eines Vermögenswertes erzielt bzw. bei der Übertragung einer Verbindlichkeit gezahlt würde. Der beizulegende Zeitwert einer Verbindlichkeit entspricht ihrem Ausfallrisiko.

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

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

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

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

###### (v) Bewertung zu fortgeführten Anschaffungskosten

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

###### (vi) Derivate – Allgemeines

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

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

###### (vii) Derivate – OTC-Swaps

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

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

###### (viii) Im Rahmen einer Wiederverkaufsvereinbarung gekaufte Wertpapiere

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

###### (ix) Sicherheiten

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

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

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

###### (x) Geldmarktinstrumente

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### C. Verbuchung der Erträge

Zinserträge auf erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltene Finanzinstrumente für das Geschäftsjahr werden in der Gesamtergebnisrechnung von anderen Gewinnen und Verlusten getrennt periodengerecht vor Abzug der ggf. anfallenden Quellensteuer ausgewiesen.

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

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

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

Bankzinserträge und -aufwendungen werden in der Gesamtergebnisrechnung periodengerecht ausgewiesen.

##### D. Dividendenerträge

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

##### E. Erfassung von Aufwendungen

Alle Aufwendungen werden in der Gesamtergebnisrechnung periodengerecht ausgewiesen.

##### F. Rückkaufbare, gewinnberechtignte Anteile

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



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### F. Rückkaufbare, gewinnberechtignte Anteile (Fortsetzung)

Die rückkaufbaren, gewinnberechtignten Anteile werden als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert und werden zum aktuellen Wert der Rückzahlungsbeträge bewertet.

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

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

##### H. Fremdwährung

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

Die Gesellschaft betreibt jedoch mehrere Fonds, wobei jeder gemäß Angabe in der Bilanz seine eigene, jeweils festgelegte Funktionalwährung hat.

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

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

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

Die obige Umrechnungsmethode führt zu einem Umrechnungsbetrag. Der nominale Wechselkursverlust von 2.935.004 US\$ (30. Juni 2019: Wechselkursgewinn in Höhe von 4.090.013 US\$ in der Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtignter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens) in der Gesamtergebnisrechnung ist durch die Anwendung von durchschnittlichen Wechselkursen und die Veränderung der Wechselkurse zwischen dem 1. Juli 2019 und dem 30. Juni 2020 bedingt. Dies ist eine nominale Wechselkursbereinigung und hat keine Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der einzelnen Fonds.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

##### I. Transaktionskosten

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

##### J. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente umfassen Bankguthaben, Kassenbestände, Kontokorrentverbindlichkeiten sowie sonstige kurzfristige Einlagen bei Kreditinstituten mit ursprünglichen Laufzeiten von höchstens drei Monaten. Zahlungsmitteläquivalente sind kurzfristige hoch liquide Anlagen, die jederzeit in bekannte Barbeträge umgewandelt werden können und unwesentlichen Wertänderungen unterliegen. Sie werden nicht zu Anlage- oder sonstigen Zwecken gehalten, sondern um kurzfristigen Zahlungsverpflichtungen nachzukommen.

##### K. Saldierung von Finanzinstrumenten

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

##### L. Sonstige Vermögenswerte und sonstige Verbindlichkeiten

Forderungen aus verkauften Wertpapieren/Kapitalanteilen und Verbindlichkeiten für gekaufte Wertpapiere/Kapitalanteile sind Forderungen für verkaufte Wertpapiere/ausgegebene Kapitalanteile bzw. Verbindlichkeiten für gekaufte Wertpapiere/zurückgenommene Kapitalanteile, deren Kauf bzw. Verkauf zwar abgeschlossen ist, die aber am Bilanzstichtag noch nicht abgerechnet bzw. geliefert sind. Diese Positionen waren zum 30. Juni 2019 in den sonstigen Vermögenswerten und sonstigen Verbindlichkeiten enthalten.

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

##### M. Zahlungsmittel für Margin-Calls an/von Kontrahenten

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020
	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
	\$	\$	€	€	\$	£	£	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(4.197.857)	671.282	(12.479)	(33.885)	49.459	–	–	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(43.371.682)	7.486	7.827.106	186.431	(94.162.303)	(1.287.375)	(1.711.179)	(2.160.559)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(389.359)	(18.761)	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	240.846.376	1.791.191	(102)	(327)	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	4.408.731	–	(51.934)	(414.357)	(1.723.165)	(328.614)	552.348	163.046
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	(3.108)	(388)	–	–	–	–	–	–
	<b>197.293.101</b>	<b>2.450.810</b>	<b>7.762.591</b>	<b>(262.138)</b>	<b>(95.836.009)</b>	<b>(1.615.989)</b>	<b>(1.158.831)</b>	<b>(1.997.513)</b>

	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020
	L&G Gold Mining UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	L&G Cyber Security UCITS ETF	L&G All Commodities UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF	L&G Battery Value- Chain UCITS ETF	L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	–	–	16.337.595	83.926.192	(9.824.982)	(821.540)	(3.962.190)	405.424
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	58.452.126	(9.649.842)	(88.501)	65.764	(913.918)	(149.752)	130.494	4.036
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	–	–	(33.230)	(79.650)	–	–	(157.230)	(6.491)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	–	–	46.984.742	142.255.560	–	–	11.268.736	2.782.055
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	6.515.951	54.266	325	177	(229.018)	(139.146)	–	(5)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	–	–	(2.530)	(60)	–	–	(82)	(14)
	<b>64.968.077</b>	<b>(9.595.576)</b>	<b>63.198.401</b>	<b>226.167.983</b>	<b>(10.967.918)</b>	<b>(1.110.438)</b>	<b>7.279.728</b>	<b>3.185.005</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020
	L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	L&G US Equity UCITS ETF	L&G UK Equity UCITS ETF	L&G Japan Equity UCITS ETF	L&G Global Equity UCITS ETF	L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	L&G Clean Water UCITS ETF
	\$	\$	£	\$	\$	€	\$	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(159.389)	(1.515.282)	(74.709)	639.725	(433.946)	245.304	(157.931)	(1.406.653)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	16.614	–	(147)	1.367	(1.353)	(8.702)	(1.976)	8.539
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(24.386)	–	340	(10.888)	2.865	8.322	(19.952)	(7.233)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	5.715.764	7.717.122	(1.602.958)	223.104	597.618	(1.477.411)	(4.180.841)	628.048
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	454	–	3	(928)	(23)	70	1.136	(174)
	<b>5.549.057</b>	<b>6.201.840</b>	<b>(1.677.471)</b>	<b>852.380</b>	<b>165.161</b>	<b>(1.232.417)</b>	<b>(4.359.564)</b>	<b>(777.473)</b>

	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2020
	L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup>	L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>2</sup>
	\$	\$	€	\$
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(19.408)	760.960	(29.145.561)	(56.660.875)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	858	3.265	(6.190)	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(4.499)	(3.943)	(32.262)	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	6.329.831	2.708.908	(2.292.076)	22.206.232
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	11	(6)	(530)	–
	<b>6.306.793</b>	<b>3.469.184</b>	<b>(31.476.619)</b>	<b>(34.454.643)</b>

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 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	14.964.820	–	(4.638)	(5.289)	1.057.379	3.369	6.324	90.071
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften	21.237.147	–	(116.311)	(242.874)	14.563.865	45.421	96.736	1.077.245
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	60.237.756	(663.063)	(8.288)	(20.451)	–	–	–	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(53.221.897)	1.014	(561.989)	959.493	(70.388.561)	(11.607)	(690.062)	(6.026.875)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(20.193.824)	21.735	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	42.219.319	1.672.674	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	3.086.376	–	2.321.362	(4.890.570)	(632.504)	(54.698)	125.666	2.189.879
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	11.429.290	3.011	–	–	–	–	–	–
	<b>79.758.987</b>	<b>1.035.371</b>	<b>1.630.136</b>	<b>(4.199.691)</b>	<b>(55.399.821)</b>	<b>(17.515)</b>	<b>(461.336)</b>	<b>(2.669.680)</b>

	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 2019	Geschäfts- jahr zum 30. Juni 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 LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup>	L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup>	L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup>	L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF <sup>1</sup>	L&G Cyber Security UCITS ETF
	\$	\$	\$	€	\$	\$	\$	\$
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten	318.098	56.881	–	164.891	2.290.887	405.844	10.458.546	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften	3.943.515	635.264	–	–	–	–	–	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	–	–	(2.658.573)	390.505	507.195	(343.671)	(5.885.655)	63.287.288
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	33.008.870	263.610	(317.693)	–	(3.023.833)	(349.713)	263.412	(93.760)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	–	–	237.100	25	704.344	(1.106.798)	(20.090.027)	113.898
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	–	–	(22.457.987)	(107.166)	1.348.881	550.183	7.247.313	36.805.465
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	4.015.918	(6.063)	(325)	–	499.732	(163.302)	–	533
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	–	–	2.132	(26)	(259.894)	78.089	11.604.889	119
	<b>41.286.401</b>	<b>949.692</b>	<b>(25.195.346)</b>	<b>448.229</b>	<b>2.067.312</b>	<b>(929.368)</b>	<b>3.598.478</b>	<b>100.113.543</b>

<sup>1</sup> 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. Am 1. September 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für diese Fonds.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G All Commodities UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G Battery Value-Chain UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF \$	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF \$	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G US Equity UCITS ETF \$	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G UK Equity UCITS ETF £	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G Japan Equity UCITS ETF \$
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten	78.081	19.717	–	–	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften	988.784	254.225	–	–	–	–	–	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	–	–	291.421	(147.157)	(77.286)	11.328	31.368	94.694
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(3.774.202)	(2.369.837)	3.473	(5.257)	(1.630)	–	(1.352)	120.161
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	–	–	(10.667)	4.273	1.443	–	1.208	(123.271)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	–	–	(2.422.231)	(228.818)	(17.241)	6.987.655	458.343	1.072.114
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	174.934	(153.514)	–	4	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	–	–	76	–	90	–	83	3
	<b>(2.532.403)</b>	<b>(2.249.409)</b>	<b>(2.137.928)</b>	<b>(376.955)</b>	<b>(94.624)</b>	<b>6.998.983</b>	<b>489.650</b>	<b>1.163.701</b>

	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G Global Equity UCITS ETF \$	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF €	Berichtszeitraum vom 7. November 2018 bis zum 30. Juni 2019 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF \$	Berichtszeitraum vom 25. Juni 2019 bis zum 30. Juni 2019 L&G Clean Water UCITS ETF \$	Berichtszeitraum vom 26. Juni 2019 bis zum 30. Juni 2019 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF \$	Berichtszeitraum vom 26. Juni 2019 bis zum 30. Juni 2019 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF \$
Zinserträge aus Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten	–	–	–	–	–	–
Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften	–	–	–	–	–	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	22.947	4.704.400	21.408	1.082	951	294
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Derivaten	(18.230)	(55.574)	7.190	(434)	(107)	(227)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	17.292	40.357	(10.974)	351	67	174
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	1.421.390	7.144.864	1.567.448	28.795	43.636	49.227
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Derivaten	–	–	–	–	–	–
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Fremdwährungen	90	(73)	690	–	–	–
	<b>1.443.489</b>	<b>11.833.974</b>	<b>1.585.762</b>	<b>29.794</b>	<b>44.547</b>	<b>49.468</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (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.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 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 19.791 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.

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 aber mehrere Sammelkonten eingerichtet, jeweils eins für jede der von den Fonds der Gesellschaft genutzten Handelswährungen. Alle Zeichnungsgelder, Rücknahmeerlöse, Dividendenzahlungen und Liquidationszahlungen von Fonds werden über die Sammelkonten gezahlt. Die Salden auf diesen Barsammelkonten zum 30. Juni 2020 und 30. Juni 2019 werden als unwesentlich in Bezug auf den jeweiligen Fonds erachtet, an den sie fällig sind. Hiervon ausgenommen sind der L&G Cyber Security UCITS ETF, der L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF, der L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF und der L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF, die in der Position „Barguthaben“ in der Bilanz zum 30. Juni 2020 (L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF zum 30. Juni 2019) angepasst wurden.

#### 5. Sicherheiten

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

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

In den nachstehenden Tabellen sind die Beträge, die Fonds mit synthetischer Nachbildung als Sicherheit für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhalten haben, sowie der Kontrahent und der beizulegende Zeitwert der entsprechenden umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 aufgeführt:

Fonds	Kontrahent	Beizulegender Zeitwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2020	Beizulegender Zeitwert der Sicherheiten zum 30. Juni 2020*	% der Position
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	27.985.328 €	29.123.206 €	104,00 %
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	63.846.403 €	66.475.730 €	104,00 %
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	404.461.433 \$	433.830.073 \$	107,00 %
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	11.616.000 £	12.659.277 £	109,00 %
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	23.686.751 £	24.460.714 £	103,00 %
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	Merrill Lynch International	45.160.750 \$	48.739.359 \$	108,00 %
L&G Gold Mining UCITS ETF	Merrill Lynch International	242.098.799 \$	259.341.338 \$	107,00 %
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	12.558.700 \$	12.884.279 \$	103,00 %
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	45.918.070 \$	49.589.789 \$	108,00 %
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	Barclays Bank Plc	7.224.553 \$	7.850.341 \$	109,00 %
<b>Insgesamt</b>		<b>904.185.086 \$</b>	<b>965.474.556 \$</b>	

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



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

### 5. Sicherheiten (Fortsetzung)

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

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 %
<b>Insgesamt</b>		<b>1.007.764.308 \$</b>	<b>1.061.552.864 \$</b>	

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

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

Von Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten	Merrill Lynch International Zum 30. Juni 2020	Citigroup Global Markets Limited Zum 30. Juni 2020	Barclays Bank Plc Zum 30. Juni 2020	Insgesamt Zum 30. Juni 2020
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	–	220.285 €	–	220.285 €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	–	–	7.169.848 \$	7.169.848 \$
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	–	100.000 £	–	100.000 £
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	400.000 \$	–	–	400.000 \$
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	–	340.200 \$	–	340.200 \$
L&G All Commodities UCITS ETF	–	–	880.000 \$	880.000 \$
<b>Insgesamt</b>	<b>400.000 \$</b>	<b>711.178 \$</b>	<b>8.049.848 \$</b>	<b>9.161.026 \$</b>

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 \$
<b>Insgesamt</b>	<b>4.919.398 \$</b>	<b>1.047.677 \$</b>	<b>7.360.957 \$</b>	<b>13.328.032 \$</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

### 5. Sicherheiten (Fortsetzung)

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

Bei Swap-Kontrahenten hinterlegte Barsicherheiten	Merrill Lynch International Zum 30. Juni 2020	Citigroup Global Markets Limited Zum 30. Juni 2020	Barclays Bank Plc Zum 30. Juni 2020	Insgesamt Zum 30. Juni 2020
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	–	69.926 £	–	69.926 £
L&G Gold Mining UCITS ETF	6.430.000 \$	–	–	6.430.000 \$
<b>Insgesamt</b>	<b>6.430.000 \$</b>	<b>86.401 \$</b>	<b>–</b>	<b>6.516.401 \$</b>

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 \$
<b>Insgesamt</b>	<b>–</b>	<b>1.570.853 \$</b>	<b>1.339.941 \$</b>	<b>2.910.794 \$</b>

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

### 6. Grundkapital

Bei Gründung betrug das genehmigte Kapital der Gesellschaft 2,00 US\$, aufgeteilt in 2 „Zeichneranteile“ im Nennwert von je 1 US\$ und 500.000.000.000.000.000 nennwertlose Anteile. Die Zeichneranteile 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 werden von LGIMH und der Verwaltungsgesellschaft gehalten.

Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber bei einer Abstimmung zu einer Stimme je Zeichneranteil, geben den Inhabern keinen Anspruch auf Dividenden und im Fall einer Abwicklung berechtigen sie die Inhaber zum Erhalt des darauf eingezahlten Betrages, aber nicht zur anderweitigen Beteiligung am Nettovermögen der Gesellschaft. Jeder gewinnberechtigte Anteil der Gesellschaft berechtigt den Inhaber zu einer Stimme je Anteil und auf die vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit beschlossenen Dividenden und hat im Falle der Abwicklung oder Auflösung der Gesellschaft vorrangig vor den Inhabern der Zeichneranteile zunächst Anspruch auf einen Betrag in Höhe des 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 des Anteilnehmers zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 6. Grundkapital (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle weist die zahlenmäßige Veränderung bei gewinnberechtigten Anteilen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 aus:

	Eröffnungs- bestand – am 1. Juli 2019 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurück- genommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2020 aus- gegebene Anteile
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	1.680.000	400.000	(350.000)	1.730.000
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	116.791	259.269	(255.851)	120.209
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	16.086.036	21.731.102	(16.183.772)	21.633.366
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	42.652.421	20.540.366	(27.099.000)	36.093.787
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	18.950	107.285	(68.350)	57.885
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	1.985.569	5.889.000	(4.524.865)	3.349.704
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	750.788	315.106	(262.127)	803.767
L&G Gold Mining UCITS ETF	8.088.889	4.202.204	(4.729.000)	7.562.093
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	5.598.066	1.823.000	(2.510.000)	4.911.066
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	59.440.500	2.900.000	(14.909.884)	47.430.616
L&G Cyber Security UCITS ETF	57.803.776	32.390.000	(8.657.000)	81.536.776
L&G All Commodities UCITS ETF	5.363.310	1.073.000	(245.000)	6.191.310
L&G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF	791.187	–	–	791.187
L&G Battery Value–Chain UCITS ETF	5.810.000	10.550.000	(4.210.000)	12.150.000
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	800.000	1.900.000	(550.000)	2.150.000
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	500.000	5.250.000	(200.000)	5.550.000
L&G US Equity UCITS ETF	10.500.000	2.200.000	(932.733)	11.767.267
L&G UK Equity UCITS ETF	900.000	300.000	–	1.200.000
L&G Japan Equity UCITS ETF	9.250.000	3.395.000	(1.460.000)	11.185.000
L&G Global Equity UCITS ETF	2.600.000	400.000	(100.000)	2.900.000
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	9.250.000	841.000	(730.012)	9.360.988
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	2.300.000	2.305.639	–	4.605.639
L&G Clean Water UCITS ETF	200.000	1.300.000	–	1.500.000
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	200.000	6.346.000	(50.000)	6.496.000
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	200.000	2.450.000	–	2.650.000
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup>	–	20.700.000	(11.500.000)	9.200.000
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>2</sup>	–	86.200.000	(28.800.000)	57.400.000

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 6. Grundkapital (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle weist die zahlenmäßige Veränderung bei gewinnberechtigten Anteilen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 aus:

	Eröffnungs- bestand – am 1. Juli 2018 ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile	Im Geschäftsjahr zurück- genommene Anteile	Schlussbestand – am 30. Juni 2019 aus- gegebene Anteile
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	1.480.000	400.000	(200.000)	1.680.000
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	113.666	100.689	(97.564)	116.791
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	16.678.036	10.860.500	(11.452.500)	16.086.036
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	59.909.437	12.520.641	(29.777.657)	42.652.421
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	21.604	36.000	(38.654)	18.950
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	2.421.635	1.412.751	(1.848.817)	1.985.569
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	796.088	206.700	(252.000)	750.788
L&G Gold Mining UCITS ETF	8.808.689	1.515.200	(2.235.000)	8.088.889
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	5.511.066	2.572.000	(2.485.000)	5.598.066
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	76.740.500	600.000	(17.900.000)	59.440.500
L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF: EUR Distributing ETF <sup>1</sup>	1.444.709	–	(1.444.709)	–
L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF: USD Distributing ETF <sup>1</sup>	3.423.063	814.200	(4.237.263)	–
L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF: GBP Hedged Distributing ETF <sup>1</sup>	5.709.309	1.550.000	(7.259.309)	–
L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF: GBP Hedged Distributing ETF <sup>1</sup>	185.636	26.457	(212.093)	–
L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF: EUR Hedged Distributing ETF <sup>1</sup>	2.300.000	–	(2.300.000)	–
L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF: USD Distributing ETF <sup>1</sup>	1.205.808	195.000	(1.400.808)	–
L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF: USD Distributing ETF <sup>1</sup>	25.118.400	2.650.000	(27.768.400)	–
L&G Cyber Security UCITS ETF	46.197.776	21.200.000	(9.594.000)	57.803.776
L&G All Commodities UCITS ETF	2.050.000	3.814.910	(501.600)	5.363.310
L&G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF	3.190.000	25.000	(2.423.813)	791.187
L&G Battery Value–Chain UCITS ETF	3.210.000	3.000.000	(400.000)	5.810.000
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	300.000	750.000	(250.000)	800.000
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	300.000	200.000	–	500.000
L&G US Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	–	10.500.000	–	10.500.000
L&G UK Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	–	900.000	–	900.000
L&G Japan Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	–	9.250.000	–	9.250.000
L&G Global Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	–	2.600.000	–	2.600.000
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	–	16.450.000	(7.200.000)	9.250.000
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF <sup>2</sup>	–	2.300.000	–	2.300.000
L&G Clean Water UCITS ETF <sup>3</sup>	–	200.000	–	200.000
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF <sup>4</sup>	–	200.000	–	200.000
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF <sup>4</sup>	–	200.000	–	200.000

<sup>1</sup> 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. Am 1. September 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für diese Fonds.

<sup>2</sup> Die Fonds wurden am 7. November 2018 aufgelegt.

<sup>3</sup> Der Fonds wurde am 25. Juni 2019 aufgelegt.

<sup>4</sup> Die Fonds wurden am 26. Juni 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 7. Effizientes Portfoliomanagement

Die Gesellschaft kann im Namen jedes Fonds und vorbehaltlich der Bedingungen und innerhalb der von der Zentralbank festgelegten Grenzen Techniken und Instrumente in Bezug auf Wertpapiere zum effizienten Portfoliomanagement einsetzen. Transaktionen für die Zwecke des effizienten Portfoliomanagements können in der Absicht durchgeführt werden, eine Risikominderung, eine Kostenreduzierung oder eine Steigerung des Kapitals oder der Renditen für einen Fonds zu erzielen 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 Geschäftsjahre zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 gab es keine Transaktionskosten in Verbindung mit dem Kauf- und Verkaufspreis von umgekehrten Pensionsgeschäften.

Nachstehende Tabelle weist die Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 aus:

Fonds	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	(112.798) €	(116.311) €
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	(301.201) €	(242.874) €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	8.506.720 \$	14.563.865 \$
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	44.339 £	45.421 £
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	80.685 £	96.736 £
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	776.799 \$	1.077.245 \$
L&G Gold Mining UCITS ETF	3.501.388 \$	3.943.515 \$
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	315.742 \$	635.264 \$
L&G All Commodities UCITS ETF	814.855 \$	988.784 \$
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	131.714 \$	254.225 \$
	<b>13.746.987 \$</b>	<b>21.237.147 \$</b>

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.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

##### Die Verwaltungsgesellschaft

Die LGIM ETF Managers Limited fungierte bis zum 31. März 2020 als Verwaltungsgesellschaft. Die LGIM Managers (Europe) Limited wurde mit Wirkung vom 31. März 2020 als die neue Verwaltungsgesellschaft bestellt.

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. Seit dem Ende des Geschäftsjahres zum 30. Juni 2019 hat es keine Veränderung in der TER der einzelnen Fonds gegeben. Hiervon ausgenommen ist nur die 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, die mit Wirkung vom 1. Oktober 2019 von 0,75 % auf 0,49 % reduziert wurde.

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 Untieranlageverwalter, die Registerstelle, den Sponsor, die Vertriebsstelle sowie andere Dienstleister der Gesellschaft zahlbaren Gebühren ein. twaige Fehlbeträge werden von der Verwaltungsgesellschaft getragen.

Die der Gesellschaft im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 insgesamt angefallenen Verwaltungsgebühren beliefen sich auf 21.003.913 US\$ (30. Juni 2019: 20.540.004 US\$), von denen 2.059.179 US\$ (30. Juni 2019: 3.064.599 US\$) zum 30. Juni 2020 noch ausstanden.

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

##### 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.\*
- Societe Generale SA\*
- Goldman Sachs International\*

\* 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, die bisherige Vertriebsstelle der Gesellschaft. Herr Weeks ist am 31. März 2020 als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft zurückgetreten.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

##### Beziehungen der Verwaltungsratsmitglieder (Fortsetzung)

Herr Weeks erhielt ein Honorar von 16.532 € (30. Juni 2019: 20.000 €) für die der Gesellschaft im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 erbrachten Dienste. Herr Weeks erhielt und erhält keine variable Vergütung.

Herr Feargal Dempsey ist ein unabhängiges, nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied und wurde am 14. Januar 2020 in den Verwaltungsrat berufen. Herr Dempsey erhielt ein Honorar von 18.575 € für der Gesellschaft im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 erbrachte Dienstleistungen.

Herr Adrian Waters und Frau Eimear Cowhey erhielten Bezüge von 37.500 € bzw. 32.500 € (30. Juni 2019: 30.000 € bzw. 25.000 €) für der Gesellschaft im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 erbrachte Dienstleistungen.

Herr Howie Li wurde am 23. März 2020 in den Verwaltungsrat berufen. Frau Patrizia Libotte wurde am 23. Juni 2020 in den Verwaltungsrat berufen. Herr Li und Frau Libotte sind zusammen mit Frau Amy Ellison nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft und der Gesellschaft.

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

Die Verwaltungsratsmitglieder und der Gesellschaftssekretär, die am 30. Juni 2020 im Amt waren, hatten weder zu diesem Zeitpunkt noch zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahres Beteiligungen an Anteilen der Gesellschaft. Ihre Familien hatten ebenfalls weder zu diesem Zeitpunkt noch zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahres ebenfalls Beteiligungen an Anteilen der Gesellschaft.

Alle Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind auch Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft.

Die Zeichneranteile werden von LGIMH und der Verwaltungsgesellschaft gehalten.

#### 9. Betriebliche Aufwendungen

Die LGIM ETF Managers Limited fungierte bis zum 31. März 2020 als Verwaltungsgesellschaft. Die LGIM Managers (Europe) Limited wurde mit Wirkung vom 31. März 2020 als die neue Verwaltungsgesellschaft bestellt. Der Verwahrstellenvertrag wurde dann zum selben Termin auf die neue Verwaltungsgesellschaft übertragen. Gemäß dem Verwahrstellenvertrag zwischen der Gesellschaft, der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle erbringt die Verwahrstelle verschiedene Verwahrerdienste 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 Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (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 Transfer- und Registerstelle 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. Vergütung der Abschlussprüfer

Die für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 berechneten Honorare für die Abschlussprüfung werden von der Verwaltungsgesellschaft getragen. KPMG erbrachte im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 Steuerberatungsdienstleistungen. Ansonsten hat Ernst & Young (30. Juni 2019: KPMG) als Abschlussprüfer der Gesellschaft keine sonstigen Assurance-Dienstleistungen oder prüfungsfremde Leistungen erbracht. In der folgenden Tabelle sind die im jeweiligen Geschäftsjahr berechneten Gebühren aufgeführt.

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 €	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 €
Gesetzlich vorgeschriebene Prüfung*	127.500	146.600
Sonstige Assurance-Dienstleistungen	–	–
Steuerberatungsdienstleistungen**	–	110.222
Sonstige prüfungsfremde Leistungen	–	–

\* Prüfungsaufwendungen sind berücksichtigt, und die ausgewiesenen Beträge verstehen sich ohne Mehrwertsteuer.

\*\* Die ausgewiesenen Beträge verstehen sich ohne Mehrwertsteuer.



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 11. Swap-Gebühren

Die Swap-Gebühren werden dem Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, belastet und beziehen sich auf die Finanzierungskosten und Gebühren im Zusammenhang mit den Swap-Kontrahenten eingegangenen Swap-Kontrakten. Die Swap-Zinsen richten sich nach dem betreffenden Libor-/Euribor-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 Geschäftsjahre zum 30. Juni 2020 und 30. Juni 2019 aufgeführt:

Fonds	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	(129.891) €	(181.687) €
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	167.168 €	3.429 €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	(9.629.308) \$	(16.191.208) \$
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	(170.953) £	(141.833) £
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	(124.458) £	(140.201) £
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	(652.082) \$	(1.081.311) \$
L&G Gold Mining UCITS ETF	(4.941.900) \$	(5.205.137) \$
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	(553.415) \$	(927.742) \$
L&G All Commodities UCITS ETF	(913.918) \$	(1.095.876) \$
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	(149.752) \$	(284.354) \$
<b>Insgesamt</b>	<b>(17.171.291) \$</b>	<b>(25.353.982) \$</b>

#### 12. Finanzinstrumente und damit verbundene Risiken

##### 1. Risikomanagement

Die Gesellschaft setzt sich durch ihre Tätigkeit verschiedenen finanziellen Risiken aus, wie z. B. dem Marktrisiko (das sich aus dem 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 12.5 (*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. In Bezug auf den L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungstätigkeiten (d. h. die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte des Fonds) an den jeweiligen Unteranlageverwalter unterdelegiert.

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

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

##### 1. Risikomanagement (Fortsetzung)

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 oder der Verwahrstelle.

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

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

Darüber hinaus 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 in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2020 und 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.

##### Kapitalrisikomanagement

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 2. Fonds mit physischer Nachbildung

##### A. Marktrisiko

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

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

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

	30. Juni 2020	30. Juni 2019
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	1.354.198 \$	1.196.439 \$
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	40.767.714 \$	46.580.290 \$
L&G Cyber Security UCITS ETF	77.289.857 \$	45.581.297 \$
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	5.558.430 \$	2.349.449 \$
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	1.279.155 \$	392.072 \$
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	2.945.246 \$	235.615 \$
L&G US Equity UCITS ETF	6.856.549 \$	5.620.401 \$
L&G UK Equity UCITS ETF	545.448 £	480.339 £
L&G Japan Equity UCITS ETF	5.805.665 \$	4.659.013 \$
L&G Global Equity UCITS ETF	1.623.715 \$	1.406.550 \$
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	4.980.554 €	5.006.426 €
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	2.360.544 \$	1.325.888 \$
L&G Clean Water UCITS ETF	773.372 \$	100.959 \$
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	4.136.124 \$	98.643 \$
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	1.662.259 \$	100.736 \$
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup>	4.638.532 €	Nicht zutreffend
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>2</sup>	30.110.377 \$	Nicht zutreffend

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

###### (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.

Die nachstehenden Tabellen weisen das Währungsrisiko der Fonds mit physischer Nachbildung (mit Ausnahme des L&G US Equity UCITS ETF und des L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF, für die kein Währungsrisiko besteht) zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 aus.

30. Juni 2020 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögen \$	Summe Netto- vermögen \$
Chinesischer Yuan Renminbi	27.083.962	427.439	–	27.511.401
	<b>27.083.962</b>	<b>427.439</b>	<b>–</b>	<b>27.511.401</b>

30. Juni 2020 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	Summe Netto- vermögen \$
Kanadischer Dollar	8.707.592	319	266	8.708.177
Chinesischer Yuan Renminbi	10.629.088	–	–	10.629.088
Euro	79.538.799	–	2.898	79.541.697
Japanischer Yen	160.205.412	49	534.377	160.739.838
Koreanischer Won	11.394.937	–	–	11.394.937
Britisches Pfund	27.577.132	–	1.733	27.578.865
Schwedische Krone	17.112.696	–	(403)	17.112.293
Schweizer Franken	32.105.730	–	(735)	32.104.995
Taiwanesischer Dollar	57.101.300	–	–	57.101.300
	<b>404.372.686</b>	<b>368</b>	<b>538.136</b>	<b>404.911.190</b>

30. Juni 2020 L&G Cyber Security UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	Summe Netto- vermögen \$
Euro	42.797.220	–	–	42.797.220
Japanischer Yen	32.562.574	–	–	32.562.574
Koreanischer Won	16.178.743	–	–	16.178.743
Britisches Pfund	56.424.993	9.377	–	56.434.370
Schwedische Krone	34.662.597	30.120	–	34.692.717
	<b>182.626.127</b>	<b>39.497</b>	<b>–</b>	<b>182.665.624</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

30. Juni 2020 L&G Battery Value-Chain UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögen \$	
Australischer Dollar	11.523.558	–	–	11.523.558
Kanadischer Dollar	3.359.744	5.806	–	3.365.550
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	3.912	3.912
Euro	15.245.927	2.784	–	15.248.711
Hongkong Dollar	9.643.559	–	–	9.643.559
Japanischer Yen	32.442.268	–	–	32.442.268
Koreanischer Won	8.439.849	–	–	8.439.849
Britisches Pfund	2.986.902	170	–	2.987.072
Schweizer Franken	3.833.232	326	–	3.833.558
	<b>87.475.039</b>	<b>9.086</b>	<b>3.912</b>	<b>87.488.037</b>

30. Juni 2020 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögen \$	
Australischer Dollar	1.628.360	–	–	1.628.360
Euro	2.108.391	–	–	2.108.391
Japanischer Yen	3.991.478	–	8.665	4.000.143
Schwedische Krone	853.580	296	–	853.876
Schweizer Franken	2.051.241	–	–	2.051.241
	<b>10.633.050</b>	<b>296</b>	<b>8.665</b>	<b>10.642.011</b>

30. Juni 2020 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögen \$	
Kanadischer Dollar	1.943.126	–	(14)	1.943.112
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	80.101	80.101
Dänische Krone	3.477.786	–	(273)	3.477.513
Euro	9.965.681	–	(755)	9.964.926
Hongkong Dollar	2.521.309	–	–	2.521.309
Japanischer Yen	10.223.389	3.827	(3.826)	10.223.390
Koreanischer Won	1.615.526	–	–	1.615.526
Neuseeland-Dollar	1.604.788	–	–	1.604.788
Britisches Pfund	2.006.366	–	(554)	2.005.812
Schweizer Franken	1.574.073	–	(50)	1.574.023
	<b>34.932.044</b>	<b>3.827</b>	<b>74.629</b>	<b>35.010.500</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

30. Juni 2020 L&G UK Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen £
	Anlagen £	Zahlungsmittel £	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) £	
Euro	105.238	329	7.886	113.453
US-Dollar	146.834	383	1.728	148.945
	<b>252.072</b>	<b>712</b>	<b>9.614</b>	<b>262.398</b>

30. Juni 2020 L&G Japan Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Japanischer Yen	116.113.301	468.761	(331.188)	116.250.874
	<b>116.113.301</b>	<b>468.761</b>	<b>(331.188)</b>	<b>116.250.874</b>

30. Juni 2020 L&G Global Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	745.411	–	1.699	747.110
Kanadischer Dollar	1.115.044	1.211	2.662	1.118.917
Dänische Krone	224.306	42	–	224.348
Euro	3.185.119	1.627	4.693	3.191.439
Hongkong Dollar	400.164	2.460	1.259	403.883
Israelischer Schekel	51.871	191	–	52.062
Japanischer Yen	2.750.943	–	4.123	2.755.066
Neuseeland-Dollar	39.361	143	–	39.504
Norwegische Krone	74.324	804	–	75.128
Britisches Pfund	1.536.541	(413)	2.478	1.538.606
Singapur-Dollar	125.098	901	150	126.149
Schwedische Krone	301.678	1.045	–	302.723
Schweizer Franken	979.412	–	–	979.412
	<b>11.529.272</b>	<b>8.011</b>	<b>17.064</b>	<b>11.554.347</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

30. Juni 2020 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) €	
Australischer Dollar	125.158	–	–	125.158
Dänische Krone	4.544.484	–	–	4.544.484
Hongkong Dollar	29.047	–	–	29.047
Norwegische Krone	1.524.981	1.026	–	1.526.007
Britisches Pfund	414.465	57	–	414.522
Schwedische Krone	7.182.481	9.255	530	7.192.266
Schweizer Franken	20.517.513	–	–	20.517.513
US-Dollar	799.089	416	1.482	800.987
	<b>35.137.218</b>	<b>10.754</b>	<b>2.012</b>	<b>35.149.984</b>

30. Juni 2020 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	26.278.570	119	111.548	26.390.237
Hongkong Dollar	13.668.994	–	42.433	13.711.427
Neuseeland-Dollar	1.580.941	–	996	1.581.937
Singapur-Dollar	4.827.895	(183)	2.047	4.829.759
	<b>46.356.400</b>	<b>(64)</b>	<b>157.024</b>	<b>46.513.360</b>

30. Juni 2020 L&G Clean Water UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Euro	1.948.265	–	6.451	1.954.716
Hongkong Dollar	714.216	–	6.163	720.379
Japanischer Yen	1.358.092	–	–	1.358.092
Britisches Pfund	1.014.475	91	12.973	1.027.539
Schwedische Krone	288.501	–	–	288.501
Schweizer Franken	540.220	–	–	540.220
	<b>5.863.769</b>	<b>91</b>	<b>25.587</b>	<b>5.889.447</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

30. Juni 2020 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	1.286.166	–	–	1.286.166
Chinesischer Yuan Renminbi	324.749	57	–	324.806
Euro	3.194.465	572	–	3.195.037
Hongkong Dollar	1.526.400	–	–	1.526.400
Japanischer Yen	–	387	–	387
Britisches Pfund	1.054.473	–	–	1.054.473
Taiwanesischer Dollar	743.904	–	3.623	747.527
	<b>8.130.157</b>	<b>1.016</b>	<b>3.623</b>	<b>8.134.796</b>

30. Juni 2020 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	366.355	–	–	366.355
Dänische Krone	275.544	44	–	275.588
Euro	2.048.668	605	7.169	2.056.442
Hongkong Dollar	550.417	–	–	550.417
Japanischer Yen	249.434	330	–	249.764
Britisches Pfund	539.226	7	–	539.233
Schweizer Franken	1.317.352	317	–	1.317.669
	<b>5.346.996</b>	<b>1.303</b>	<b>7.169</b>	<b>5.355.468</b>

30. Juni 2020 L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup>	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) €	
Dänische Krone	3.568.239	446	–	3.568.685
Norwegische Krone	770.002	–	–	770.002
Polnischer Zloty	296.228	–	–	296.228
Britisches Pfund	19.824.236	3.845	32.165	19.860.246
Schwedische Krone	5.065.675	702	933	5.067.310
Schweizer Franken	15.511.353	–	–	15.511.353
US-Dollar	–	–	3.568	3.568
	<b>45.035.733</b>	<b>4.993</b>	<b>36.666</b>	<b>45.077.392</b>

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

30. Juni 2019 L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Netto- vermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögen \$	
Chinesischer Yuan Renminbi	23.928.786	200.575	–	24.129.361
	<b>23.928.786</b>	<b>200.575</b>	<b>–</b>	<b>24.129.361</b>

30. Juni 2019 L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Netto- vermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Kanadischer Dollar	9.402.453	–	–	9.402.453
Chinesischer Yuan Renminbi	10.621.747	–	–	10.621.747
Euro	98.375.140	–	–	98.375.140
Japanischer Yen	203.375.289	(312.543)	634.401	203.697.147
Koreanischer Won	13.037.628	–	–	13.037.628
Britisches Pfund	28.982.935	–	–	28.982.935
Schwedische Krone	19.658.266	–	–	19.658.266
Schweizer Franken	32.889.133	–	–	32.889.133
Taiwanesischer Dollar	54.147.365	144.725	–	54.292.090
	<b>470.489.956</b>	<b>(167.818)</b>	<b>634.401</b>	<b>470.956.539</b>

30. Juni 2019 L&G Cyber Security UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Netto- vermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/ (-verbindlichkeiten) \$	
Euro	11.655.215	(50)	–	11.655.165
Japanischer Yen	70.104.275	–	–	70.104.275
Koreanischer Won	32.938.673	55.032	–	32.993.705
Britisches Pfund	72.001.804	655	–	72.002.459
Schwedische Krone	34.948.964	800	–	34.949.764
	<b>221.648.931</b>	<b>56.437</b>	<b>–</b>	<b>221.705.368</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

30. Juni 2019 L&G Battery Value-Chain UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögen \$	
Australischer Dollar	1.305.727	–	–	1.305.727
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	6.683	6.683
Euro	4.782.528	675	–	4.783.203
Hongkong Dollar	3.083.885	–	–	3.083.885
Japanischer Yen	21.435.647	–	–	21.435.647
Koreanischer Won	5.033.895	–	12.157	5.046.052
Schweizer Franken	1.710.856	217	–	1.711.073
	<b>37.352.538</b>	<b>892</b>	<b>18.840</b>	<b>37.372.270</b>

30. Juni 2019 L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögen \$	
Australischer Dollar	284.252	–	–	284.252
Euro	858.064	–	–	858.064
Japanischer Yen	686.514	5.446	(5.447)	686.513
Koreanischer Won	195.953	–	–	195.953
Britisches Pfund	251.767	–	–	251.767
Schwedische Krone	230.141	–	–	230.141
Schweizer Franken	491.645	–	–	491.645
	<b>2.998.336</b>	<b>5.446</b>	<b>(5.447)</b>	<b>2.998.335</b>

30. Juni 2019 L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF Funktionalwährung	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Nettovermögen \$	
Kanadischer Dollar	138.185	–	–	138.185
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	4.259	4.259
Dänische Krone	158.742	–	–	158.742
Euro	831.798	–	–	831.798
Hongkong Dollar	246.935	–	–	246.935
Japanischer Yen	1.017.468	–	–	1.017.468
Koreanischer Won	111.011	–	–	111.011
Britisches Pfund	114.378	–	–	114.378
Schweizer Franken	305.768	–	–	305.768
	<b>2.924.285</b>	<b>–</b>	<b>4.259</b>	<b>2.928.544</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

30. Juni 2019 L&G UK Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen £
	Anlagen £	Zahlungsmittel £	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) £	
Euro	102.729	(715)	5.163	107.177
Norwegische Krone	12.676	–	–	12.676
US-Dollar	185.373	–	9.768	195.141
	<b>300.778</b>	<b>(715)</b>	<b>14.931</b>	<b>314.994</b>

30. Juni 2019 L&G Japan Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Japanischer Yen	93.180.252	264.005	(132.058)	93.312.199
	<b>93.180.252</b>	<b>264.005</b>	<b>(132.058)</b>	<b>93.312.199</b>

30. Juni 2019 L&G Global Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	749.619	–	3.982	753.601
Kanadischer Dollar	1.030.861	776	2.862	1.034.499
Dänische Krone	150.471	–	–	150.471
Euro	2.961.692	(413)	1.669	2.962.948
Hongkong Dollar	354.126	–	327	354.453
Israelischer Sichel	22.362	–	–	22.362
Japanischer Yen	2.386.202	–	3.529	2.389.731
Neuseeland-Dollar	17.618	–	49	17.667
Norwegische Krone	76.905	–	–	76.905
Britisches Pfund	1.658.661	576	5.487	1.664.724
Singapur-Dollar	99.749	–	–	99.749
Schwedische Krone	278.778	–	–	278.778
Schweizer Franken	829.393	128	–	829.521
	<b>10.616.437</b>	<b>1.067</b>	<b>17.905</b>	<b>10.635.409</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

30. Juni 2019 L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen €
	Anlagen €	Zahlungsmittel €	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) €	
Australischer Dollar	93.202	–	–	93.202
Dänische Krone	3.816.582	–	–	3.816.582
Hongkong Dollar	25.516	–	–	25.516
Norwegische Krone	1.913.679	–	–	1.913.679
Britisches Pfund	660.611	–	–	660.611
Schwedische Krone	6.588.792	–	–	6.588.792
Schweizer Franken	18.644.820	10.234	–	18.655.054
US-Dollar	803.700	(4)	4.153	807.849
	<b>32.546.902</b>	<b>10.230</b>	<b>4.153</b>	<b>32.561.285</b>

30. Juni 2019 L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	14.638.021	–	86.640	14.724.661
Hongkong Dollar	7.743.662	–	11.696	7.755.358
Neuseeland-Dollar	680.912	–	733	681.645
Singapur-Dollar	2.856.763	–	–	2.856.763
	<b>25.919.358</b>	<b>–</b>	<b>99.069</b>	<b>26.018.427</b>

30. Juni 2019 L&G Clean Water UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Euro	35.707	–	–	35.707
Hongkong Dollar	126.879	–	–	126.879
Japanischer Yen	108.408	–	–	108.408
Britisches Pfund	147.118	–	–	147.118
Schwedische Krone	47.625	–	–	47.625
Schweizer Franken	51.653	–	–	51.653
	<b>517.390</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>517.390</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

30. Juni 2019 L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	31.683	–	–	31.683
Chinesischer Yuan Renminbi	9.195	–	–	9.195
Euro	85.407	–	–	85.407
Hongkong Dollar	36.106	–	–	36.106
Japanischer Yen	14.382	–	–	14.382
Britisches Pfund	48.462	–	–	48.462
Taiwanesischer Dollar	44.962	–	–	44.962
	<b>270.197</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>270.197</b>

30. Juni 2019 L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	Fremdwährungsrisiko			Summe Nettovermögen \$
	Anlagen \$	Zahlungsmittel \$	Sonstige Netto- vermögenswerte/(-ver- bindlichkeiten) \$	
Australischer Dollar	22.179	–	–	22.179
Dänische Krone	16.170	–	–	16.170
Euro	81.533	–	–	81.533
Hongkong Dollar	14.166	–	–	14.166
Japanischer Yen	30.240	–	–	30.240
Britisches Pfund	35.250	–	–	35.250
Schweizer Franken	76.505	–	–	76.505
	<b>276.043</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>276.043</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### A. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

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

	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % steigt 30. Juni 2020	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % fällt 30. Juni 2020	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % steigt 30. Juni 2019	Veränderung der Anlagen, wenn der Wechselkurs um 5 % fällt 30. Juni 2019
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	(1.289.712) \$	1.425.472 \$	(1.139.466 \$)	1.259.410 \$
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	(19.255.842) \$	21.282.773 \$	(22.404.284 \$)	24.762.629 \$
L&G Cyber Security UCITS ETF	(8.696.482) \$	9.611.901 \$	(10.554.711 \$)	11.665.733 \$
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	(4.165.478) \$	4.603.949 \$	(1.778.692 \$)	1.965.923 \$
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	(506.336) \$	559.634 \$	(142.778 \$)	157.807 \$
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	(1.663.431) \$	1.838.529 \$	(139.252 \$)	153.910 \$
L&G UK Equity UCITS ETF	(12.003) £	13.267 £	(14.323 £)	15.830 £
L&G Japan Equity UCITS ETF	(5.529.205) \$	6.111.226 \$	(4.437.155 \$)	4.904.224 \$
L&G Global Equity UCITS ETF	(549.013) \$	606.804 \$	(505.544 \$)	558.760 \$
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	(1.673.201) €	1.849.327 €	(1.549.853 €)	1.712.995 €
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	(2.207.448) \$	2.439.811 \$	(1.234.255 \$)	1.364.177 \$
L&G Clean Water UCITS ETF	(279.227) \$	308.619 \$	(24.638 \$)	27.231 \$
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	(387.150) \$	427.903 \$	(12.866 \$)	14.221 \$
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	(254.619) \$	281.421 \$	(13.145 \$)	14.529 \$
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup>	(2.144.559) €	2.370.302 €	Nicht zutreffend	Nicht zutreffend

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

##### (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 vom Anlageverwalter oder dem Unteranlageverwalter in Übereinstimmung mit den Zielen und der Strategie sowie den bestehenden Verfahrensweisen, wie sie im Abschnitt Informationen über die Gesellschaft festgelegt sind, gesteuert. Nach Auffassung des Anlageverwalters besteht für die Fonds mit physischer Nachbildung ein minimales Zinsrisiko, da sich das Risiko auf Bankguthaben beschränkt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 12. 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.

Mit Wirkung vom 1. Dezember 2019 wurde die BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited mit The Bank of New York Mellon SA/NV verschmolzen, die selbst eine hundertprozentige Tochtergesellschaft von The Bank of New York Mellon ist, (die „Verschmelzung“). Nach der Verschmelzung ist The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, das Unternehmen, das für die Gesellschaft Treuhänder-, Verwahr- und/oder Depotdienste erbringt.

Im Wesentlichen alle in den Fonds gehaltenen liquiden Mittel und Wertpapiere werden über die Verwahrstelle gehalten. The Bank of New York Mellon SA/NV hat zum 30. Juni 2020 ein langfristiges Emittenten-Kreditrating von S&P von AA-. Vor der Verschmelzung war die BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited selbst kein Unternehmen mit Rating, aber ihre letztendliche Muttergesellschaft, The Bank of New York Mellon Corporation, hat zum 30. Juni 2019 ein langfristiges Emittenten-Kreditrating von S&P von A.

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

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

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.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### B. Kreditrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

##### 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 Anteilsrücknahmen in größerem Umfang kann es jedoch erforderlich werden, dass die Fonds ihre Anlagen schneller liquidieren als wünschenswert, um liquide Mittel für Rücknahmen zu beschaffen. Diese Faktoren können sich negativ auf den Wert der zurückgenommenen Anteile und die Bewertung der noch umlaufenden Anteile auswirken sowie auf die Liquidität der verbleibenden Anteile, wenn die liquideren Vermögenswerte verkauft wurden, um die Rücknahmen durchzuführen.

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



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### C. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

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

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### C. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

Sämtliche Verbindlichkeiten zum 30. Juni 2020 und 30. Juni 2019 sind in weniger als einem Monat fällig.

#### 3. Fonds mit synthetischer Nachbildung

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

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

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

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

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

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

- staatliche Interventionen auf europäischer, internationaler und nationaler Ebene, einschließlich neuer, sich auf die jeweiligen Produkte und Märkte auswirkender Gesetze, wozu insbesondere EMIR und der Dodd-Frank Act gehören können, die sich auf die künftige Fähigkeit der Gesellschaft zum Eingehen oder Fortsetzen dieser OTC-Swap-Transaktionen auswirken und/oder die diesbezüglichen Kosten erhöhen können.
- Unter bestimmten Umständen können Bewertungen für OTC-Swaps und/oder Indizes nur von einer begrenzten Anzahl Marktteilnehmer verfügbar sein, die möglicherweise gleichzeitig Kontrahenten dieser Transaktionen sind. Bei der Bewertung oder 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 Anteilinhaber ändern (möglicherweise auch reduzieren).

##### B. Marktrisiko

Das Marktrisiko ist das Risiko, dass der Wert von gehaltenen Instrumenten aufgrund von Veränderungen der Marktpreise, die durch das 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“).

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

###### **Leveraged Funds (gehebelte Fonds)**

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.

###### **Leveraged Inverse Funds (gehebelte inverse Fonds)**

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

Dies bedeutet, dass der Fonds darauf abzielt, für seine Anteilinhaber 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).

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

#### Leveraged Inverse Funds (Fortsetzung)

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

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

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

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

In der nachstehenden Tabelle sind die Fonds aufgeführt, die gehebelte Indizes oder gehebelte inverse Indizes nachbilden, sowie jeweils die entsprechenden Basisindizes:

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

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

###### (ii) Währungsrisiko

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

Die Fonds mit synthetischer Nachbildung haben im Geschäftsjahr 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 wurde vom Anlageverwalter oder dem Unteranlageverwalter in Übereinstimmung mit den Zielen und der Strategie sowie den bestehenden Verfahrensweisen, wie sie im Abschnitt Informationen über die Gesellschaft festgelegt sind, gesteuert. Die in der Tabelle dargestellten derivativen Finanzinstrumente stellen den nicht realisierten Gewinn/Verlust aus den Positionen im Gegensatz zu dem von der Position generierten Gesamtexposure dar, welches rund 100 % des Werts des Fonds beträgt. Die von den Fonds vereinnahmten Zinserträge dienen der Finanzierung der Zinsverbindlichkeiten aus den Swap-Positionen. Das Zins- und Laufzeitenprofil der verzinslichen Anlagen der betreffenden Fonds, einschließlich der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds, kategorisiert entweder nach dem Termin der vertraglich vereinbarten Zinsanpassung oder dem Fälligkeitstermin, je nachdem welcher der beiden Zeitpunkte früher eintritt, lauteten zum 30. Juni 2020 wie folgt:

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

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

L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	2.664.282	–	–	–	–	–	2.664.282
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	220.285	–	–	–	–	–	220.285
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden							
–Geldmarktinstrumente	1.416.838	–	–	–	–	–	1.416.838
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	176.861	176.861
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	27.985.328	–	–	–	–	–	27.985.328
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>32.286.733</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>176.861</b>	<b>32.463.594</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Fällige Kapitalbeteiligungen	–	–	–	–	–	(2.093.896)	(2.093.896)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(15.408)	(15.408)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(2.109.304)</b>	<b>(2.109.304)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>32.286.733</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1.932.443)</b>	<b>30.354.290</b>

L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	4.918.341	–	–	–	–	–	4.918.341
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	63.846.403	–	–	–	–	–	63.846.403
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	3.858	3.858
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>68.764.744</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>3.858</b>	<b>68.768.602</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(6.287)	–	–	–	–	–	(6.287)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(951.684)	(951.684)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(38.498)	(38.498)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(6.287)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(990.182)</b>	<b>(996.469)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>68.758.457</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(986.324)</b>	<b>67.772.133</b>



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	152	–	–	–	–	–	152
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	7.169.848	–	–	–	–	–	7.169.848
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	25.761.829	–	–	–	–	–	25.761.829
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	1.951.562	1.951.562
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	404.461.433	–	–	–	–	–	404.461.433
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	20.587	20.587
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>437.393.262</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.972.149</b>	<b>439.365.411</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(121.865)	(121.865)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(121.865)</b>	<b>(121.865)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>437.393.262</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.850.284</b>	<b>439.243.546</b>

L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	910.837	–	–	–	–	–	910.837
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	100.000	–	–	–	–	–	100.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	187.493	–	–	–	–	–	187.493
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	11.616.000	–	–	–	–	–	11.616.000
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>12.814.330</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>12.814.330</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(317.987)	(317.987)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(8.634)	(8.634)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(326.621)</b>	<b>(326.621)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>12.814.330</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(326.621)</b>	<b>12.487.709</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	5	–	–	–	–	–	5
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	1.942.759	–	–	–	–	–	1.942.759
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	526.945	526.945
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	23.686.751	–	–	–	–	–	23.686.751
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>25.629.515</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>526.945</b>	<b>26.156.460</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(69.926)	–	–	–	–	–	(69.926)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(13.078)	(13.078)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(69.926)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(13.078)</b>	<b>(83.004)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>25.559.589</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>513.867</b>	<b>26.073.456</b>

L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	249	–	–	–	–	–	249
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	400.000	–	–	–	–	–	400.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	3.026.326	–	–	–	–	–	3.026.326
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	284.054	284.054
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	45.160.750	–	–	–	–	–	45.160.750
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	3.926	3.926
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>48.587.325</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>287.980</b>	<b>48.875.305</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(18.700)	(18.700)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(18.700)</b>	<b>(18.700)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>48.587.325</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>269.280</b>	<b>48.856.605</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

L&G Gold Mining UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	24.932.004	–	–	–	–	–	24.932.004
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	13.355.572	13.355.572
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	242.098.799	–	–	–	–	–	242.098.799
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	7.328	7.328
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>267.030.803</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>13.362.900</b>	<b>280.393.703</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Kontokorrentverbindlichkeiten	(1.546)	–	–	–	–	–	(1.546)
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(6.430.000)	–	–	–	–	–	(6.430.000)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(161.516)	(161.516)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(6.431.546)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(161.516)</b>	<b>(6.593.062)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>260.599.257</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>13.201.384</b>	<b>273.800.641</b>

L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	340.200	–	–	–	–	–	340.200
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	428.239	–	–	–	–	–	428.239
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	12.558.700	–	–	–	–	–	12.558.700
Forderungen aus verkauften □ Wertpapieren	–	–	–	–	–	13.068.700	13.068.700
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	470	470
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>13.327.139</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>13.069.170</b>	<b>26.396.309</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(240.235)	(240.235)
Fällige gekaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	(12.558.700)	(12.558.700)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(18.592)	(18.592)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(12.817.527)</b>	<b>(12.817.527)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>13.327.139</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>251.643</b>	<b>13.578.782</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

L&G All Commodities UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	880.000	–	–	–	–	–	880.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	3.554.208	–	–	–	–	–	3.554.208
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	113.694	113.694
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	45.918.070	–	–	–	–	–	45.918.070
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	2.408	2.408
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>50.352.278</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>116.102</b>	<b>50.468.380</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(7.910)	(7.910)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(7.910)</b>	<b>(7.910)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>50.352.278</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>108.192</b>	<b>50.460.470</b>
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	545.656	–	–	–	–	–	545.656
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	33.305	33.305
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	7.224.553	–	–	–	–	–	7.224.553
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	367	367
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>7.770.209</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>33.672</b>	<b>7.803.881</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(2.226)	(2.226)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(2.226)</b>	<b>(2.226)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>7.770.209</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>31.446</b>	<b>7.801.655</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

Das Zins- und Laufzeitenprofil der verzinslichen Anlagen der betreffenden Fonds, einschließlich der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds, kategorisiert entweder nach dem Termin der vertraglich vereinbarten Zinsanpassung oder dem Fälligkeitstermin, je nachdem welcher der beiden Zeitpunkte früher eintritt, lauteten zum 30. Juni 2019 wie folgt:

L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	5.415.140	–	–	–	–	–	5.415.140
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	500.000	–	–	–	–	–	500.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	228.795	228.795
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	30.435.515	–	–	–	–	–	30.435.515
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>36.350.655</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>228.795</b>	<b>36.579.450</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(3.158.259)	(3.158.259)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(3.158.259)</b>	<b>(3.158.259)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>36.350.655</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(2.929.464)</b>	<b>33.421.191</b>

L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	€	€	€	€	€	€	€
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	3.844.246	–	–	–	–	–	3.844.246
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	65.550.481	–	–	–	–	–	65.550.481
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1.195	1.195
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>69.394.727</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.195</b>	<b>69.395.922</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(920.000)	–	–	–	–	–	(920.000)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(537.327)	(537.327)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(73.011)	(73.011)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(920.000)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(610.338)</b>	<b>(1.530.338)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>68.474.727</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(609.143)</b>	<b>67.865.584</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	895	–	–	–	–	–	895
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	43.868.974	–	–	–	–	–	43.868.974
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	3.674.727	3.674.727
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	550.666.365	–	–	–	–	–	550.666.365
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	4.115.588	4.115.588
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>594.536.234</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>7.790.315</b>	<b>602.326.549</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(6.513.495)	–	–	–	–	–	(6.513.495)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(6.386.723)	(6.386.723)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(6.513.495)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(6.386.723)</b>	<b>(12.900.218)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>588.022.739</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.403.592</b>	<b>589.426.331</b>

L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	431.248	–	–	–	–	–	431.248
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	10.627	10.627
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	5.686.924	–	–	–	–	–	5.686.924
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>6.118.172</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>10.627</b>	<b>6.128.799</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Kontokorrentverbindlichkeiten	(142)	–	–	–	–	–	(142)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(5.646)	(5.646)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(142)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(5.646)</b>	<b>(5.788)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>6.118.030</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.981</b>	<b>6.123.011</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	£	£	£	£	£	£	£
<b>Vermögenswerte</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	87.000	–	–	–	–	–	87.000
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	975.133	–	–	–	–	–	975.133
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	13.281.737	–	–	–	–	–	13.281.737
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1.015	1.015
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>14.343.870</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.015</b>	<b>14.344.885</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Kontokorrentverbindlichkeiten	(330)	–	–	–	–	–	(330)
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(25.402)	(25.402)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(14.318)	(14.318)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(330)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(39.720)</b>	<b>(40.050)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>14.343.540</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(38.705)</b>	<b>14.304.835</b>

L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzinslich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	18.053	–	–	–	–	–	18.053
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	1.339.941	–	–	–	–	–	1.339.941
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	2.126.977	–	–	–	–	–	2.126.977
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	121.008	121.008
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	45.557.021	–	–	–	–	–	45.557.021
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	12.016	12.016
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>49.041.992</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>133.024</b>	<b>49.175.016</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(42.994)	(42.994)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(42.994)</b>	<b>(42.994)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>49.041.992</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>90.030</b>	<b>49.132.022</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

L&G Gold Mining UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	1.197	–	–	–	–	–	1.197
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	13.401.929	–	–	–	–	–	13.401.929
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	6.839.621	6.839.621
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	195.643.135	–	–	–	–	–	195.643.135
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	156.365	156.365
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>209.046.261</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>6.995.986</b>	<b>216.042.247</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(4.919.398)	–	–	–	–	–	(4.919.398)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(261.159)	(261.159)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(4.919.398)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(261.159)</b>	<b>(5.180.557)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>204.126.863</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>6.734.827</b>	<b>210.861.690</b>

L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	6.209	–	–	–	–	–	6.209
Zahlungsmittel für Margin-Calls an Kontrahenten	890.738	–	–	–	–	–	890.738
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	1.549.273	–	–	–	–	–	1.549.273
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	25.843.485	–	–	–	–	–	25.843.485
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	27.431.566	27.431.566
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>28.289.705</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>27.431.566</b>	<b>55.721.271</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	(294.501)	(294.501)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(25.976.008)	(25.976.008)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(26.270.509)</b>	<b>(26.270.509)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>28.289.705</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.161.057</b>	<b>29.450.762</b>



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### B. Marktrisiko (Fortsetzung)

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

L&G All Commodities UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	21	–	–	–	–	–	21
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	4.624.037	–	–	–	–	–	4.624.037
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	342.712	342.712
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	48.713.000	–	–	–	–	–	48.713.000
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	19.426	19.426
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>53.337.058</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>362.138</b>	<b>53.699.196</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(647.793)	–	–	–	–	–	(647.793)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(24.434)	(24.434)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(647.793)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(24.434)</b>	<b>(672.227)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>52.689.265</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>337.704</b>	<b>53.026.969</b>

L&G Longer Dated All Commodities ex- Agriculture and Livestock UCITS ETF	Weniger als 1 Monat	1-3 Monate	3 Monate bis zu 1 Jahr	1-5 Jahre	Mehr als 5 Jahre	Nicht verzins- lich	Insgesamt
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
<b>Vermögenswerte</b>							
Bankguthaben	201.931	–	–	–	–	–	201.931
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet							
–Geldmarktinstrumente	733.023	–	–	–	–	–	733.023
–Derivative Finanzinstrumente	–	–	–	–	–	172.451	172.451
–Umgekehrte Pensionsgeschäfte	7.893.000	–	–	–	–	–	7.893.000
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	2.143	2.143
<b>Gesamtvermögenswerte</b>	<b>8.827.954</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>174.594</b>	<b>9.002.548</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>							
Zahlungsmittel für Margin-Calls von Kontrahenten	(199.669)	–	–	–	–	–	(199.669)
Sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	(6.180)	(6.180)
<b>Gesamtverbindlichkeiten (ohne das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(199.669)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(6.180)</b>	<b>(205.849)</b>
<b>Zinssensitivitätslücke</b>	<b>8.628.285</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>168.414</b>	<b>8.796.699</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

##### C. Kreditrisiko

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

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

Die Fonds mit synthetischer Nachbildung setzen Total Return Index Swaps ein, die mit einem oder mehreren OTC-Swap-Kontrahenten eingegangen werden (im Berichtsjahr 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 Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### C. Kreditrisiko (Fortsetzung)

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

Steigt oder fällt der Wert des jeweils von einem Fond nachgebildeten Index, verbuchen die mit einem Swap-Kontrahenten eingegangenen Total Return Index Swaps einen Gewinn oder Verlust für den Fonds. Der Gewinn oder Verlust aus dem Swap wird zwischen der Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) und dem Swap-Kontrahenten monatlich abgerechnet. Innerhalb eines Monats übertragen die Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) und der Swap-Kontrahent jeweils Barsicherheiten (ausschließlich in der Basiswährung des Fonds) in einer Höhe, die dem täglichen Gewinn/Verlust aus dem Index-Swap entspricht, soweit der jeweilige Gewinn/Verlust einen vereinbarten Schwellenbetrag übersteigt. Um tägliche Übertragungen unwesentlicher Barbeträge zu vermeiden, erfolgen Übertragungen von Barsicherheiten lediglich in der Höhe, in der der jeweilige Gewinn-/Verlustbetrag an einem Tag den vereinbarten Mindestübertragungsbetrag für den betreffenden Fonds übersteigt, der gemäß den von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank vorgeschriebenen Grenzen und EMIR festgelegt wird.

Von dem Swap-Kontrahenten als Sicherheit für den Swap an die Gesellschaft (auf Rechnung des betreffenden Fonds) übertragene Barmittel sind im 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 1.151.183 US\$ für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (30. Juni 2019: 1.621.446 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 30. Juni 2020 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.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### C. Kreditrisiko (Fortsetzung)

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

Das langfristige Kredit-Rating von S&P für die Barclays Bank Plc ist A (30. Juni 2019: A), für Citigroup Global Markets Limited ist A+ (30. Juni 2019: A+) und für Merrill Lynch International ist A+ (30. Juni 2019: A+).

Mit Wirkung vom 1. Dezember 2019 wurde die BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited mit The Bank of New York Mellon SA/NV verschmolzen, die selbst eine hundertprozentige Tochtergesellschaft von The Bank of New York Mellon ist, (die „Verschmelzung“). Nach der Verschmelzung ist The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, das Unternehmen, das für die Gesellschaft Treuhänder-, Verwahr- und/oder Depotdienste erbringt.

Im Wesentlichen alle in den Fonds gehaltenen liquiden Mittel und Wertpapiere werden über die Verwahrstelle gehalten. The Bank of New York Mellon SA/NV hat zum 30. Juni 2020 ein langfristiges Emittenten-Kreditrating von S&P von AA-. Vor der Verschmelzung war die BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited selbst kein Unternehmen mit Rating, aber ihre letztendliche Muttergesellschaft, The Bank of New York Mellon Corporation, hat zum 30. Juni 2019 ein langfristiges Emittenten-Kreditrating von S&P von A.

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.

Zum 30. Juni 2020 hielten die Fonds Einschusszahlungen, Barbestände, Geldmarktinstrumente, umgekehrte Pensionsgeschäfte bzw. OTC-Swaps wie nachstehend angegeben:

Fonds	Bank of New York Mellon 30. Juni 2020	% des Nettovermögens	Merrill Lynch International 30. Juni 2020	% des Nettovermögens	Citigroup Global Markets Limited 30. Juni 2020	% des Nettovermögens	Barclays Bank Plc 30. Juni 2020	% des Nettovermögens
<b>Insgesamt</b>	<b>72.107.016 \$</b>	<b>2 %</b>	<b>294.869.175 \$</b>	<b>6 %</b>	<b>159.093.953 \$</b>	<b>3 %</b>	<b>467.752.465 \$</b>	<b>10 %</b>

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
<b>Insgesamt</b>	<b>78.866.218 \$</b>	<b>2 %</b>	<b>197.563.358 \$</b>	<b>6 %</b>	<b>159.150.308 \$</b>	<b>5 %</b>	<b>651.119.268 \$</b>	<b>19 %</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### C. Kreditrisiko (Fortsetzung)

##### (ii) Transaktionen mit autorisierten Teilnehmern

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

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

Die Zahlstelle für die Fonds ist dafür zuständig, an den jeweiligen Zahlungsterminen die Zahlungen an Teilnehmer in Bezug auf Dividendengelder und die Erlöse von Zwangsrücknahmen von ETF-Anteilen zu veranlassen.

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

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

#### D. Liquiditätsrisiko

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### D. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

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 Anteilrücknahmen in größerem Umfang kann es jedoch erforderlich werden, dass die Fonds ihre Anlagen schneller liquidieren als wünschenswert, um liquide Mittel für Rücknahmen zu beschaffen. Diese Faktoren können sich negativ auf den Wert der zurückgenommenen Anteile und die Bewertung der noch umlaufenden Anteile auswirken sowie auf die Liquidität der verbleibenden Anteile, wenn die liquideren Vermögenswerte verkauft wurden, um die Rücknahmen durchzuführen.

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

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

- I. während der gesamten Dauer oder Teilen eines Zeitraums, in dem einer der Hauptmärkte, an dem ein wesentlicher Teil der Werte des Index, auf den sich der betreffende Fonds oder die Anlagen des betreffenden Fonds beziehen, notiert oder gelistet ist oder gehandelt wird, oder eines Zeitraums, in dem die Devisenmärkte für die Basiswährung des Fonds oder die Währung, auf die ein wesentlicher Teil der Titel des Index, auf den sich der betreffende Fonds oder die Anlagen des betreffenden Fonds beziehen, lauten, geschlossen sind (außer während der üblichen Schließungszeiten an Wochenenden oder normalen Feiertagen) oder eines Zeitraums, während dessen der dortige Handel eingeschränkt oder ausgesetzt ist oder der Handel an einer Terminbörse oder einem relevanten Terminmarkt ausgesetzt ist;
- II. während der gesamten Dauer oder Teilen eines Zeitraums, in dem aufgrund politischer, wirtschaftlicher, militärischer oder währungsbezogener Ereignisse oder anderer Umstände, die nicht dem Einfluss, der Verantwortung oder der Macht des Verwaltungsrats unterliegen, eine Veräußerung oder Bewertung von Anlagen des betreffenden Fonds nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht ohne Nachteile für die Interessen der Anteilinhaber im Allgemeinen oder der Inhaber von Anteilen des betreffenden Fonds in angemessener Weise durchführbar ist, oder falls der Nettoinventarwert nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht in angemessener Weise berechnet werden kann oder die Veräußerung erhebliche Nachteile für die Anteilinhaber im Allgemeinen oder die Inhaber von Anteile des betreffenden Fonds zur Folge hätte;
- III. während der gesamten Dauer oder in Teilen eines Zeitraums, in dem die normalerweise für die Ermittlung des Wertes einer der Anlagen der Gesellschaft verwendeten Kommunikationsmittel ausfallen, oder in dem aus irgendeinem Grund der Wert einer der Anlagen oder anderen Vermögenswerte des betreffenden Fonds nicht in angemessener oder gerechtfertigter Weise festgestellt werden kann;

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### D. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

- IV. während der gesamten Dauer oder in Teilen eines Zeitraums, in dem die Gesellschaft nicht in der Lage ist, Gelder zurückzuführen, die für Rücknahmezahlungen erforderlich sind, oder in dem solche Zahlungen nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht zu normalen Preisen oder normalen Wechselkursen durchgeführt werden können, oder in dem bei der Übertragung von Geldern oder Vermögenswerten, die für Zeichnungen, Rücknahmen oder Handelsgeschäfte erforderlich sind, Probleme bestehen oder voraussichtlich auftreten werden; oder
- V. nach Ermessen des Verwaltungsrats unter Umständen, unter denen der Verwaltungsrat eine solche Aussetzung als im besten Interesse der Gesellschaft oder des Fonds oder der Anleger des Fonds insgesamt betrachtet;
- VI. nach Veröffentlichung einer Einberufungsbekanntmachung einer Hauptversammlung von Anteilhabern, auf der die Abwicklung der Gesellschaft oder die Schließung eines Fonds beschlossen werden soll;
- VII. wenn der Handel mit den Anteilen an einer relevanten Börse, an der sie notiert sind, eingeschränkt oder ausgesetzt wird;
- VIII. wenn die Abwicklung oder Abrechnung von Wertpapieren in einem anerkannten Clearing- und Abrechnungssystem unterbrochen ist;
- IX. in einem Zeitraum, in dem der Handel mit Anteilen aufgrund einer Verfügung oder Anordnung einer zuständigen Regulierungsbehörde ausgesetzt ist;
- X. in jedem Zeitraum, in dem ein Index nicht zusammengestellt oder veröffentlicht wird.

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

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

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

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

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

#### D. Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

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

Sämtliche Verbindlichkeiten zum 30. Juni 2020 und 30. Juni 2019 sind in weniger als einem Monat fällig.

Bei OTC-Swaps stellen die Werte in der Bilanz den beizulegenden Zeitwert zum 30. Juni 2020 dar, und zum Zeitpunkt der Zahlung könnte sich der beizulegende Zeitwert aufgrund von Marktbewegungen ändern. Die Nennwerte dieser OTC-Swaps werden in der Aufstellungen der Vermögenswerte ausgewiesen.

#### 4. Beizulegender Zeitwert

Die Bilanzierungsgrundsätze der Gesellschaft zur Bewertung zum beizulegenden Zeitwert schreiben eine Zeitwerthierarchie vor, wenn Finanzinstrumente zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden, die auf folgenden Ebenen basiert:

Ebene 1 – nicht adjustierte, an aktiven Märkten notierte Preise für identische, unbeschränkte Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, zu denen die Gesellschaft am Bewertungstag Zugang hat;

Ebene 2 – Bewertungsparameter, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (d. h. als Preise) oder indirekt (d. h. abgeleitet aus Preisen) beobachtbar sind und die nicht der Ebene 1 angehören; und

Ebene 3 – Bewertungsparameter für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (d. h. nicht beobachtbare Parameter).

Die Ebene in der Zeitwerthierarchie, welcher der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments in seiner Gesamtheit zugeordnet wird, wird anhand des niedrigsten Bewertungsparameters festgelegt, der für die Zeitwertbewertung maßgeblich ist. Zu diesem Zweck wird die Signifikanz eines Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Werden bei einer Zeitwertbewertung beobachtbare Parameter verwendet, die aufgrund von nicht beobachtbaren Parametern eine maßgebliche Anpassung erfordern, so wird diese Zeitwertbewertung als der Ebene 3 zuzuordnend erachtet. Die Beurteilung der Signifikanz eines Parameters für die Zeitwertbewertung eines Finanzinstruments in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Berücksichtigung spezifischer Faktoren des jeweiligen Vermögenswerts bzw. der jeweiligen Verbindlichkeit.

Die Finanzinstrumente, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind kurzfristige finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, deren Buchwerte in etwa dem beizulegenden Zeitwert entsprechen. Dazu gehören unter anderem:

(i) Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente und Forderungen und Verbindlichkeiten gegenüber Maklern. Dabei handelt es sich um kurzfristige finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, deren Buchwerte aufgrund ihrer Kurzfristigkeit und der hohen Bonität der Geschäftspartner dem beizulegenden Zeitwert entsprechen. Die Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente und Forderungen und Verbindlichkeiten gegenüber Maklern werden auf Ebene 2 der Zeitwerthierarchie eingestuft; und



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

(li) Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen Der Fonds nimmt die rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile routinemäßig zu einem Betrag in Höhe des anteiligen Nettovermögens des Fonds zum Zeitpunkt der Rücknahme zurück bzw. gibt sie zu einem entsprechenden Betrag aus, berechnet auf einer Grundlage, die mit der in diesem Abschluss verwendeten Grundlage vereinbar ist. Dementsprechend entspricht der Buchwert des Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens annähernd ihrem beizulegenden Zeitwert. Die Anteile sind Ebene 1 der Zeitwerthierarchie zugeordnet.

Die Barbestände der Gesellschaft können in verzinsliche, kurzfristige Geldmarkt-Investmentfonds mit AAA-Rating umgeschichtet werden, die in der Bilanz der Gesellschaft als Geldmarktinstrumente klassifiziert werden. Diese Geldmarktinstrumente werden für die Gesellschaft im Namen der The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, der Verwahrstelle, gehalten. Zum 30. Juni 2020 hielt kein Fonds mehr als 17 %\* (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

30. Juni 2020	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>Insgesamt</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		67.995.888	–	–	67.995.888
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	16.587.925	–	16.587.925
Stammaktien		3.879.770.657	–	220.280	3.879.990.937
Unternehmensanleihen		–	–	29.799	29.799
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	904.185.086	–	904.185.086
		<b>3.947.766.545</b>	<b>920.773.011</b>	<b>250.079</b>	<b>4.868.789.635</b>
<b>L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		27.042.740	–	41.222	27.083.962
		<b>27.042.740</b>	<b>–</b>	<b>41.222</b>	<b>27.083.962</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF</b>	€				
Geldmarktinstrumente		1.416.838	–	–	1.416.838
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	176.861	–	176.861
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	27.985.328	–	27.985.328
		<b>1.416.838</b>	<b>28.162.189</b>	<b>–</b>	<b>29.579.027</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	€				
Geldmarktinstrumente		4.918.341	–	–	4.918.341
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	63.846.403	–	63.846.403
		<b>4.918.341</b>	<b>63.846.403</b>	<b>–</b>	<b>68.764.744</b>
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		25.761.829	–	–	25.761.829
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	1.951.562	–	1.951.562
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	404.461.433	–	404.461.433
		<b>25.761.829</b>	<b>406.412.995</b>	<b>–</b>	<b>432.174.824</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2020	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Geldmarktinstrumenten		187.493	–	–	187.493
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	11.616.000	–	11.616.000
		<b>187.493</b>	<b>11.616.000</b>	<b>–</b>	<b>11.803.493</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Geldmarktinstrumenten		1.942.759	–	–	1.942.759
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	526.945	–	526.945
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	23.686.751	–	23.686.751
		<b>1.942.759</b>	<b>24.213.696</b>	<b>–</b>	<b>26.156.455</b>
<b>L&amp;G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		3.026.326	–	–	3.026.326
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	284.054	–	284.054
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	45.160.750	–	45.160.750
		<b>3.026.326</b>	<b>45.444.804</b>	<b>–</b>	<b>48.471.130</b>
<b>L&amp;G Gold Mining UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		24.932.004	–	–	24.932.004
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	13.355.572	–	13.355.572
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	242.098.799	–	242.098.799
		<b>24.932.004</b>	<b>255.454.371</b>	<b>–</b>	<b>280.386.375</b>
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		428.239	–	–	428.239
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	12.558.700	–	12.558.700
		<b>428.239</b>	<b>12.558.700</b>	<b>–</b>	<b>12.986.939</b>
<b>L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		815.354.279	–	–	815.354.279
		<b>815.354.279</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>815.354.279</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2020	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>L&amp;G Cyber Security UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		1.545.797.144	–	–	1.545.797.144
		<b>1.545.797.144</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.545.797.144</b>
<b>L&amp;G All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		3.554.208	–	–	3.554.208
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	113.694	–	113.694
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	45.918.070	–	45.918.070
		<b>3.554.208</b>	<b>46.031.764</b>	<b>–</b>	<b>49.585.972</b>
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		545.656	–	–	545.656
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	33.305	–	33.305
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	7.224.553	–	7.224.553
		<b>545.656</b>	<b>7.257.858</b>	<b>–</b>	<b>7.803.514</b>
<b>L&amp;G Battery Value–Chain UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		111.168.602	–	–	111.168.602
		<b>111.168.602</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>111.168.602</b>
<b>L&amp;G Pharma Breakthrough UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		25.583.106	–	–	25.583.106
		<b>25.583.106</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>25.583.106</b>
<b>L&amp;G Ecommerce Logistics UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		58.904.923	–	–	58.904.923
		<b>58.904.923</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>58.904.923</b>
<b>L&amp;G US Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		137.130.983	–	–	137.130.983
		<b>137.130.983</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>137.130.983</b>
<b>L&amp;G UK Equity UCITS ETF</b>	£				
Stammaktien		10.902.785	–	6.175	10.908.960
		<b>10.902.785</b>	<b>–</b>	<b>6.175</b>	<b>10.908.960</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

30. Juni 2020	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>L&amp;G Japan Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		116.113.301	–	–	116.113.301
		<b>116.113.301</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>116.113.301</b>
<b>L&amp;G Global Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		32.456.641	–	17.662	32.474.303
		<b>32.456.641</b>	<b>–</b>	<b>17.662</b>	<b>32.474.303</b>
<b>L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF</b>	€				
Stammaktien		99.611.089	–	–	99.611.089
		<b>99.611.089</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>99.611.089</b>
<b>L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		47.055.167	–	125.915	47.181.082
Unternehmensanleihen		–	–	29.799	29.799
		<b>47.055.167</b>	<b>–</b>	<b>155.714</b>	<b>47.210.881</b>
<b>L&amp;G Clean Water UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		15.467.436	–	–	15.467.436
		<b>15.467.436</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>15.467.436</b>
<b>L&amp;G Artificial Intelligence UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		82.722.484	–	–	82.722.484
		<b>82.722.484</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>82.722.484</b>
<b>L&amp;G Healthcare Breakthrough UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		33.245.183	–	–	33.245.183
		<b>33.245.183</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>33.245.183</b>
<b>L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF<sup>1</sup></b>	€				
Stammaktien		92.745.839	–	24.797	92.770.636
		<b>92.745.839</b>	<b>–</b>	<b>24.797</b>	<b>92.770.636</b>
<b>L&amp;G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF<sup>2</sup></b>	\$				
Stammaktien		602.207.537	–	–	602.207.537
		<b>602.207.537</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>602.207.537</b>

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

### 12. 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
<b>Insgesamt</b>	\$				
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
		<b>2.387.291.993</b>	<b>1.019.188.899</b>	<b>–</b>	<b>3.406.480.892</b>
<b>L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		23.928.786	–	–	23.928.786
		<b>23.928.786</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>23.928.786</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF</b>	€				
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	228.795	–	228.795
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	30.435.515	–	30.435.515
		<b>–</b>	<b>30.664.310</b>	<b>–</b>	<b>30.664.310</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	€				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	65.550.481	–	65.550.481
		<b>–</b>	<b>65.550.481</b>	<b>–</b>	<b>65.550.481</b>
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
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
		<b>43.868.974</b>	<b>554.341.092</b>	<b>–</b>	<b>598.210.066</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Geldmarktinstrumente		431.248	–	–	431.248
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	10.627	–	10.627
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	5.686.924	–	5.686.924
		<b>431.248</b>	<b>5.697.551</b>	<b>–</b>	<b>6.128.799</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Geldmarktinstrumente		975.133	–	–	975.133
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	13.281.737	–	13.281.737
		<b>975.133</b>	<b>13.281.737</b>	<b>–</b>	<b>14.256.870</b>
<b>L&amp;G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF</b>	\$				
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
		<b>2.126.977</b>	<b>45.678.029</b>	<b>–</b>	<b>47.805.006</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

### 12. 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
<b>L&amp;G Gold Mining UCITS ETF</b>	\$				
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
		<b>13.401.929</b>	<b>202.482.756</b>	<b>–</b>	<b>215.884.685</b>
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		1.549.273	–	–	1.549.273
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	25.843.485	–	25.843.485
		<b>1.549.273</b>	<b>25.843.485</b>	<b>–</b>	<b>27.392.758</b>
<b>L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		931.605.800	–	–	931.605.800
		<b>931.605.800</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>931.605.800</b>
<b>L&amp;G Cyber Security UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		911.625.932	–	–	911.625.932
		<b>911.625.932</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>911.625.932</b>
<b>L&amp;G All Commodities UCITS ETF</b>	\$				
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
		<b>4.624.037</b>	<b>49.055.712</b>	<b>–</b>	<b>53.679.749</b>
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF</b>	\$				
Geldmarktinstrumente		733.023	–	–	733.023
Nicht realisierter Gewinn aus OTC-Swap-Transaktionen		–	172.451	–	172.451
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		–	7.893.000	–	7.893.000
		<b>733.023</b>	<b>8.065.451</b>	<b>–</b>	<b>8.798.474</b>
<b>L&amp;G Battery Value–Chain UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		46.988.976	–	–	46.988.976
		<b>46.988.976</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>46.988.976</b>
<b>L&amp;G Pharma Breakthrough UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		7.841.435	–	–	7.841.435
		<b>7.841.435</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>7.841.435</b>
<b>L&amp;G Ecommerce Logistics UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		4.712.300	–	–	4.712.300
		<b>4.712.300</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.712.300</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

### 12. 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
<b>L&amp;G US Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		112.408.028	–	–	112.408.028
		<b>112.408.028</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>112.408.028</b>
<b>L&amp;G UK Equity UCITS ETF</b>	£				
Stammaktien		9.606.775	–	–	9.606.775
		<b>9.606.775</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>9.606.775</b>
<b>L&amp;G Japan Equity UCITS ET</b>	\$				
Stammaktien		93.180.252	–	–	93.180.252
		<b>93.180.252</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>93.180.252</b>
<b>L&amp;G Global Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		28.130.113	–	–	28.130.113
Bezugsrechte		884	–	–	884
		<b>28.130.997</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>28.130.997</b>
<b>L&amp;G Europe ex UK Equity UCITS ETF</b>	€				
Stammaktien		100.109.611	–	–	100.109.611
Bezugsrechte		18.913	–	–	18.913
		<b>100.128.524</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>100.128.524</b>
<b>L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		26.517.762	–	–	26.517.762
		<b>26.517.762</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>26.517.762</b>
<b>L&amp;G Clean Water UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		2.019.176	–	–	2.019.176
		<b>2.019.176</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.019.176</b>
<b>L&amp;G Artificial Intelligence UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		1.972.857	–	–	1.972.857
		<b>1.972.857</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.972.857</b>
<b>L&amp;G Healthcare Breakthrough UCITS ETF</b>	\$				
Stammaktien		2.014.722	–	–	2.014.722
		<b>2.014.722</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.014.722</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

30. Juni 2020	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
<b>Insgesamt</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(1.702.043)	–	(1.702.043)
		–	<b>(1.702.043)</b>	–	<b>(1.702.043)</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	€				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(951.684)	–	(951.684)
		–	<b>(951.684)</b>	–	<b>(951.684)</b>
<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF</b>	£				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(317.987)	–	(317.987)
		–	<b>(317.987)</b>	–	<b>(317.987)</b>
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	\$				
Nicht realisierter Verlust aus OTC-Swap-Transaktionen		–	(240.235)	–	(240.235)
		–	<b>(240.235)</b>	–	<b>(240.235)</b>

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



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Vergleiche der Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts von Finanzanlagen der Ebene 3 zwischen dem Beginn und dem Ende des Geschäftsjahres erfolgen nachstehend. Bei der Ermittlung der Höhe von Übertragungen in und aus Ebenen der Zeitwerthierarchie wird davon ausgegangen, dass die Übertragungen zu Beginn des Geschäftsjahres erfolgt sind.

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF 30. Juni 2020	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	–	–
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	52.582	52.582
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Realisierter Verlust	–	–
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(11.360)	(11.360)
<b>Schlussbestand</b>	<b>41.222</b>	<b>41.222</b>

L&G UK Equity UCITS ETF 30. Juni 2020	Stammaktien £	Gesamt £
Anfangsbestand	–	–
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	14.754	14.754
Käufe	1.094	1.094
Verkäufe	–	–
Realisierter Verlust	–	–
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(9.673)	(9.673)
<b>Schlussbestand</b>	<b>6.175</b>	<b>6.175</b>

L&G Global Equity UCITS ETF 30. Juni 2020	Stammaktien US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	–	–
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	14.336	14.336
Käufe	5.090	5.090
Verkäufe	–	–
Realisierter Verlust	–	–
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(1.764)	(1.764)
<b>Schlussbestand</b>	<b>17.662</b>	<b>17.662</b>

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF 30. Juni 2020	Stammaktien US\$	Unternehmensanleihen US\$	Gesamt US\$
Anfangsbestand	–	–	–
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	78.275	–	78.275
Käufe	62.099	29.937	92.036
Verkäufe	(30.587)	–	(30.587)
Realisierter Verlust	(984)	–	(984)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes)	17.112	(138)	16.974
<b>Schlussbestand</b>	<b>125.915</b>	<b>29.799</b>	<b>155.714</b>

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF 30. Juni 2020	Stammaktien €	Gesamt €
Anfangsbestand	–	–
Übertragungen von der Ebene 1 in die Ebene 3	–	–
Käufe	71.881	71.881
Verkäufe	–	–
Realisierter Verlust	–	–
Veränderung des nicht realisierten Verlustes	(47.084)	(47.084)
<b>Schlussbestand</b>	<b>24.797</b>	<b>24.797</b>

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	–	–
<b>Schlussbestand</b>	<b>–</b>	<b>–</b>

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

##### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020 wurden Wertpapiere der Ebene 3 gehalten (30. Juni 2019: keine), deren Handel vor dem Bilanzstichtag ausgesetzt wurde. Das Ziel der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert bleibt jedoch dasselbe, d. h. ein Ausstiegspreis aus der Perspektive eines Marktteilnehmers, der den Vermögenswert hält oder die Verbindlichkeit schuldet. Bei keinem der ausgesetzten Wertpapiere gibt es nach Beurteilung seitens der kompetenten Person Hinweise darauf, dass der zuletzt gehandelte Kurs angepasst werden sollte, somit bleibt der zuletzt gehandelte Kurs der beste Maßstab für den beizulegenden Zeitwert der ausgesetzten Wertpapiere. Da die Beurteilung seitens der kompetenten Person zur Ermittlung eines angemessenen Zeitwerts für die ausgesetzten Wertpapiere eingesetzt wird, gilt dies als signifikanter nicht beobachtbarer Parameter.

Die folgenden Tabellen enthalten Angaben zu den signifikanten nicht beobachtbaren Parametern, die bei der Bewertung der Gesellschaft von Anlagen und Finanzinstrumenten Anwendung fanden, die am 30. Juni 2020 der Ebene 3 der Zeitwerthierarchie zugeordnet waren.

In diesen Tabellen wird auch die Anfälligkeit gegenüber Änderungen bei den signifikanten nicht beobachtbaren Parametern angegeben und die Auswirkung eines Abschlags von 10 % auf den Wert von Anlagen und die Auswirkung auf den NIW des Fonds gezeigt. Das Management hat die Anwendung eines Abschlags von 10 % zur Durchführung einer Sensitivitätsanalyse beschlossen, da dies als angemessen für einen angepassten Verkaufskurs für illiquide Wertpapiere erachtet werden kann.

L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	30. Juni 2020
<b>Anlage</b>	<b>Stammaktien</b>
Zeitwert (US\$)	41.222
Hauptbewertungstechniken	Zuletzt gehandelter Preis
Wert bei Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	782.629
NIW je Anteil vor Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	15.9057
NIW je Anteil nach Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	15.9033
Auswirkung der Anwendung des Abschlags bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern auf den NIW je Anteil	(0,0152) %

L&G UK Equity UCITS ETF	30. Juni 2020
<b>Anlage</b>	<b>Stammaktien</b>
Zeitwert (£)	6.175
Hauptbewertungstechniken	Zuletzt gehandelter Preis
Wert bei Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern* (£)	917.161
NIW je Anteil vor Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (£)	9,1355
NIW je Anteil nach Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (£)	9,1350
Auswirkung der Anwendung des Abschlags bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern auf den NIW je Anteil	(0,0056) %

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 4. Beizulegender Zeitwert (Fortsetzung)

L&G Global Equity UCITS ETF	30. Juni 2020
<b>Anlage</b>	<b>Stammaktien</b>
Zeitwert (US\$)	17.662
Hauptbewertungstechniken	Zuletzt gehandelter Preis
Wert bei Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	1.102.249
NIW je Anteil vor Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	11,2248
NIW je Anteil nach Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	11,2242
Auswirkung der Anwendung des Abschlags bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern auf den NIW je Anteil	(0,0055) %

L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	30. Juni 2020
<b>Anlage</b>	<b>Stammaktien und Unternehmensanleihen</b>
Zeitwert (US\$)	155.714
Hauptbewertungstechniken	Zuletzt gehandelter Preis
Wert bei Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	1.011.505
NIW je Anteil vor Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	10,2867
NIW je Anteil nach Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (US\$)	10,2833
Auswirkung der Anwendung des Abschlags bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern auf den NIW je Anteil	(0,0334) %

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF	30. Juni 2020
<b>Anlage</b>	<b>Stammaktien</b>
Zeitwert (€)	24.797
Hauptbewertungstechniken	Zuletzt gehandelter Preis
Wert bei Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern* (€)	1.003.289
NIW je Anteil vor Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (€)	10,0977
NIW je Anteil nach Anwendung des Abschlags aus der Sensitivitätsanalyse bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern (€)	10,0974
Auswirkung der Anwendung des Abschlags bei signifikanten nicht beobachtbaren Parametern auf den NIW je Anteil	(0,0027) %

\* Abschlag aus der Sensitivitätsanalyse von 10 %, der auf den zuletzt gehandelten Kurs dieser Wertpapiere angewandt wird, deren Handel vor dem Bilanzstichtag ausgesetzt wurde.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 12. 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“)

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 hat der Anlageverwalter bei der Ermittlung des globalen Risikos 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 Geschäftsjahr eingehalten. Dies zeigt, dass der Fonds den Basisindex auf einer Eins-zu-eins-Basis abzüglich Gebühren und aufgelaufener Kosten nachbildet. Das einseitige Konfidenzniveau des Fonds liegt bei 99 %, die Haltedauer beträgt einen Tag. Der historische Betrachtungszeitraum beträgt mindestens ein Jahr. Es kann jedoch, wenn dies angemessen ist, auch ein kürzerer Betrachtungszeitraum angewandt werden.

Die Fonds wenden keinen direkten Hebel (Leverage) an; die einzige auf die 2x-Short-Fonds und die 2x-Leveraged-Fonds mit synthetischer Nachbildung anwendbare Leverage ist in den jeweiligen, von den einzelnen Fonds nachgebildeten Index integriert, und somit nicht auf Fondsebene. Die Fonds streben stets einen relativen VaR von 1 an, außer für die 2x Short- und 2x Leveraged-Fonds, die einen relativen VaR von 2 haben. Dies ist dadurch bedingt, dass der VaR des Fonds gegenüber dem VaR des nicht gehebelten Index gemessen wird statt gegenüber der VaR des direkt nachgebildeten Index mit integrierter Leverage. 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 Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 5. Derivaterisiko (Fortsetzung)

#### B. VaR (Fortsetzung)

Für die nachstehend aufgeführten Fonds wird das Risiko anhand des relativen VaR überwacht. Die nachstehende Tabelle weist den relativen VaR für die einzelnen Fonds zum 30. Juni 2020 aus, berechnet mit einem Konfidenzniveau von 99 Prozent. Die Mindest-, Durchschnitts- und Höchstausschüttung der VaR-Limits im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 werden ebenfalls nachstehend angegeben.

Fonds	ETF VaR 1T	ETF VaR 5T	ETF VaR 20T	Geringste Ausschüttung	Durchschnittliche Ausschüttung	Höchste Ausschüttung	Tracking-Index	Index VaR 1T	Index VaR 5T	Index VaR 20T	Stichprobe Tage
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF*	8,89 %	19,88 %	39,76 %	99,86 %	99,86 %	99,87 %	LevDAX® x2 Index	4,45 %	9,95 %	19,91 %	262
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF*	8,89 %	19,88 %	39,75 %	99,83 %	99,85 %	99,87 %	ShortDAX® x2 Index	4,45 %	9,95 %	19,91 %	262
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	2,11 %	4,73 %	9,46 %	49,92 %	50,01 %	50,03 %	Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return	2,12 %	4,74 %	9,47 %	262
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF*	7,87 %	17,61 %	35,22 %	99,79 %	99,82 %	99,85 %	FTSE 100® Daily Leveraged Index	3,94 %	8,82 %	17,64 %	262
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF*	7,88 %	17,61 %	35,23 %	99,85 %	99,86 %	99,87 %	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index	3,94 %	8,82 %	17,64 %	262
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	5,90 %	13,18 %	26,36 %	49,99 %	50,00 %	50,01 %	Russell 2000® Index	5,89 %	13,18 %	26,36 %	262
L&G Gold Mining UCITS ETF	5,77 %	12,90 %	25,80 %	50,00 %	50,02 %	50,02 %	DAXglobal® Gold Miners Index	5,77 %	12,90 %	25,80 %	262
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	9,98 %	22,33 %	44,65 %	50,26 %	50,80 %	51,36 %	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR	9,80 %	21,92 %	43,85 %	262
L&G All Commodities UCITS ETF	2,38 %	5,32 %	10,64 %	49,99 %	50,01 %	50,02 %	Bloomberg Commodity Index Total Return	2,38 %	5,32 %	10,64 %	262
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	2,72 %	6,07 %	12,15 %	50,00 %	50,00 %	50,01 %	Bloomberg ex-Agriculture and Livestock 15/30 Capped 3 Month Forward Total Return Index	2,72 %	6,07 %	12,15 %	262

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

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

#### 5. Derivaterisiko (Fortsetzung)

#### B. VaR (Fortsetzung)

Für die nachstehend aufgeführten Fonds wird das Risiko anhand des relativen VaR überwacht. Die nachstehende Tabelle weist den relativen VaR für die einzelnen Fonds zum 30. Juni 2019 aus, berechnet mit einem Konfidenzniveau von 99 Prozent. Die Mindest-, Durchschnitts- und Höchstausschüttung der VaR-Limits im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 werden ebenfalls nachstehend angegeben.

Fonds	ETF VaR 1T	ETF VaR 5T	ETF VaR 20T	Geringste Ausschüttung	Durchschnittliche Ausschüttung	Höchste Ausschüttung	Tracking-Index	Index VaR 1T	Index VaR 5T	Index VaR 20T	Stichprobe Tage
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	4,36 %	9,76 %	19,52 %	99,86 %	99,87 %	99,87 %	LevDAX® x2 Index	2,18 %	4,89 %	9,77 %	262
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	4,36 %	9,76 %	19,51 %	99,86 %	99,87 %	99,89 %	ShortDAX® x2 Index	2,18 %	4,89 %	9,77 %	262
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	1,50 %	3,34 %	6,69 %	49,99 %	50,02 %	50,03 %	Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return	1,49 %	3,34 %	6,68 %	262
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	3,55 %	7,93 %	15,87 %	99,77 %	99,81 %	99,83 %	FTSE 100® Daily Leveraged Index	1,78 %	3,97 %	7,95 %	262
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	3,55 %	7,94 %	15,88 %	99,81 %	99,86 %	99,87 %	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index	1,78 %	3,98 %	7,95 %	262
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	2,67 %	5,97 %	11,94 %	49,99 %	50,00 %	50,02 %	Russell 2000® Index	2,67 %	5,97 %	11,94 %	262
L&G Gold Mining UCITS ETF	3,09 %	6,92 %	13,84 %	50,01 %	50,01 %	50,02 %	DAXglobal® Gold Miners (TR) USD	3,09 %	6,92 %	13,83 %	262
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	2,81 %	6,28 %	12,56 %	50,32 %	51,21 %	51,72 %	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR	2,79 %	6,24 %	12,49 %	262
L&G All Commodities UCITS ETF	1,72 %	3,85 %	7,69 %	49,99 %	50,00 %	50,01 %	Bloomberg Commodity Index Total Return	1,72 %	3,85 %	7,69 %	262
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	1,81 %	4,04 %	8,07 %	50,00 %	50,02 %	50,03 %	Bloomberg ex-Agriculture and Livestock 15/30 Capped 3 Month Forward Total Return	1,80 %	4,04 %	8,07 %	262

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

Um seine vertraglichen Rechte klarer zu definieren und Rechte zu sichern, die dazu beitragen, das Kontrahentenrisiko der Fonds zu verringern, haben die Fonds mit ihren Finanzinstrumenten einen ISDA-Rahmenvertrag abgeschlossen oder eine ähnliche Vereinbarung getroffen. Zu den ähnlichen Vereinbarungen zählen standardisierte Rahmenverträge für Repo-Geschäfte (Global Master Repurchase Agreements). Zu den ähnlichen Finanzinstrumenten zählen Derivate und umgekehrte Pensionsgeschäfte.

Der ISDA-Rahmenvertrag und ähnliche Rahmenverträge zur Aufrechnung entsprechen nicht den Kriterien für eine Saldierung in der Bilanz. Das liegt daran, dass die Fonds derzeit keinen einklagbaren Rechtsanspruch auf die Saldierung der ausgewiesenen Beträge haben, weil der Anspruch auf Saldierung nur bei Eintritt künftiger Ereignisse einklagbar ist wie eines Ausfalls der Fonds oder der Kontrahenten oder anderer Kreditereignisse.

Ein ISDA-Rahmenvertrag ist eine bilaterale Vereinbarung zwischen einem Fonds und einem Kontrahenten, der außerbörslich gehandelte Derivate regelt, einschließlich OTC-Swaps und Devisenterminkontrakte, und in aller Regel unter anderem Bedingungen zur Stellung von Sicherheiten sowie Aufrechnungsbestimmungen für den Fall eines Verzugs und/oder einer Kündigung vorsieht. Der ISDA-Rahmenvertrag sieht normalerweise individuelle Nettozahlungen im Fall eines Verzugs (Close-out Netting) oder ähnlicher Vorkommnisse wie dem Konkurs oder der Insolvenz des Kontrahenten vor.

Der Fonds und seine Kontrahenten haben sich jedoch für die Abrechnung aller Transaktionen auf Bruttobasis entschieden; im Falle eines Verzugs der anderen Partei hat aber jede Partei die Option, alle offenen Kontrakte auf Nettobasis abzurechnen. Zu einem Verzugsereignis gehören:

- Nichtleistung von Zahlungen bei Fälligkeit durch eine Partei;
- Nichterfüllung einer (sonstigen) vertraglichen Verpflichtung durch eine Partei, wenn nicht innerhalb von 30 Tagen Abhilfe geschaffen wird, nachdem die Partei über die Nichterfüllung unterrichtet wurde; und
- Konkurs.

Zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 unterlagen die in der Tabelle auf den Seiten 176 bis 181 im Einzelnen aufgeführten Derivate Aufrechnungsrahmenvereinbarungen mit den Derivatekontrahenten. Alle derivativen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds werden bei diesen Kontrahenten gehalten, und der verbleibende Saldo, der von den Fonds vorgehalten wird, dient dem Zweck der Bereitstellung von Sicherheiten für derivative Positionen.

Für keinen der Fonds mit physischer Nachbildung bestehen Rahmenvereinbarungen zur Aufrechnung:



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

Die folgenden Tabellen weisen die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 aus:

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finzieller Vermögenswerte	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Erhaltene Barsicherheiten*	
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>						
	<b>OTC-Swaps</b>						
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	176.861 €	–	176.861 €	–	–	176.861 €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	1.951.562 \$	–	1.951.562 \$	–	–	1.951.562 \$
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	526.945 £	–	526.945 £	–	(69.926) £	457.019 £
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	Merrill Lynch International	284.054 \$	–	284.054 \$	–	–	284.054 \$
L&G Gold Mining UCITS ETF	Merrill Lynch International	13.355.572 \$	–	13.355.572 \$	–	(6.430.000) \$	6.925.572 \$
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	113.694 \$	–	113.694 \$	–	–	113.694 \$
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	Barclays Bank Plc	33.305 \$	–	33.305 \$	–	–	33.305 \$

\* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

Die folgenden Tabellen weisen die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 aus (Fortsetzung):

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Vermögenswerte	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Erhaltene finanzielle Sicherheiten*	
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>						
	<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>						
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	27.985.328 €	–	27.985.328 €	–	(27.985.328) €	-
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	63.846.403 €	–	63.846.403 €	–	(63.846.403) €	-
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	404.461.433 \$	–	404.461.433 \$	–	(404.461.433) \$	-
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	11.616.000 £	–	11.616.000 £	–	(11.616.000) £	-
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	23.686.751 £	–	23.686.751 £	–	(23.686.751) £	-
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	Merrill Lynch International	45.160.750 \$	–	45.160.750 \$	–	(45.160.750) \$	-
L&G Gold Mining UCITS ETF	Merrill Lynch International	242.098.799 \$	–	242.098.799 \$	–	(242.098.799) \$	-
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	12.558.700 \$	–	12.558.700 \$	–	(12.558.700) \$	-
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	45.918.070 \$	–	45.918.070 \$	–	(45.918.070) \$	-
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	Barclays Bank Plc	7.224.553 \$	–	7.224.553 \$	–	(7.224.553) \$	-

\* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

Die folgenden Tabellen weisen die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 aus (Fortsetzung):

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Verbindlichkeiten	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Verpfändete Barsicherheiten*	
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>						
	<b>OTC-Swaps</b>						
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	(951.684) €	–	(951.684) €	–	–	(951.684) €
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	(317.987) £	–	(317.987) £	–	100.000 £	(217.987) £
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	(240.235) \$	–	(240.235) \$	–	240.235 \$	-

\* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

Die folgenden Tabellen weisen die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 aus:

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Vermögenswerte	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Erhaltene Barsicherheiten*	
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>						
	<b>OTC-Swaps</b>						
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	228.795 €	–	228.795 €	–	–	228.795 €
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	3.695.118 \$	(20.392) \$	3.674.726 \$	–	(3.674.726) \$	–
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	10.627 £	–	10.627 £	–	–	10.627 £
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	Barclays Bank Plc	121.008 \$	–	121.008 \$	–	–	121.008 \$
L&G Gold Mining UCITS ETF	Merrill Lynch International	6.839.621 \$	–	6.839.621 \$	–	(4.919.398) \$	1.920.223 \$
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	344.816 \$	(2.104) \$	342.712 \$	–	(342.712) \$	–
L&G Longer Dated All Commodities ex–Agriculture and Livestock UCITS ETF	Barclays Bank Plc	172.451 \$	–	172.451 \$	–	(172.451) \$	–
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	33.438 \$	(33.438) \$	–	–	–	–

\* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

Die folgenden Tabellen weisen die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 aus (Fortsetzung):

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Vermögenswerte	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Erhaltene finanzielle Sicherheiten*	
	<b>Finanzielle Vermögenswerte</b>						
	<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>						
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	30.435.515 €	–	30.435.515 €	–	(30.435.515) €	–
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	65.550.481 €	–	65.550.481 €	–	(65.550.481) €	–
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	550.666.365 \$	–	550.666.365 \$	–	(550.666.365) \$	–
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	5.686.924 £	–	5.686.924 £	–	(5.686.924) £	–
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	13.281.737 £	–	13.281.737 £	–	(13.281.737) £	–
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	Barclays Bank Plc	45.557.021 \$	–	45.557.021 \$	–	(45.557.021) \$	–
L&G Gold Mining UCITS ETF	Merrill Lynch International	195.643.135 \$	–	195.643.135 \$	–	(195.643.135) \$	–
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	25.843.485 \$	–	25.843.485 \$	–	(25.843.485) \$	–
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	48.713.000 \$	–	48.713.000 \$	–	(48.713.000) \$	–
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	Barclays Bank Plc	7.893.000 \$	–	7.893.000 \$	–	(7.893.000) \$	–

\* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

Die folgenden Tabellen weisen die Saldierung für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019 aus (Fortsetzung):

Fonds	Beschreibung	Bruttobeträge ausgewiesener finanzieller Verbindlichkeiten	In der Bilanz saldierte Bruttobeträge	Nettobeträge der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte	Entsprechende Beträge, die in der Bilanz nicht saldiert wurden		Nettobetrag
					Finanzinstrumente	Verpfändete Barsicherheiten*	
	<b>Finanzielle Verbindlichkeiten</b>						
	<b>OTC-Swaps</b>						
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	(20.392) \$	20.392 \$	–	–	–	–
L&G All Commodities UCITS ETF	Barclays Bank Plc	(2.104) \$	2.104 \$	–	–	–	–
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	(327.939) \$	33.438 \$	(294.501) \$	–	294.501 \$	–
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	(537.327) €	–	(537.327) €	–	–	(537.327) €
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	Citigroup Global Markets Limited	(25.402) £	–	(25.402) £	–	25.402 £	–

\* Entspricht den Sicherheitenbeträgen, die vom jeweiligen Kontrahenten erhalten oder an diesen gestellt wurden. Dieser Betrag ist auf den jeweiligen Betrag beschränkt, der unter den Nettobeträgen der in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerten abzüglich zu saldierender Finanzinstrumente angegeben ist.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 14. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile

Jeder Fonds wurde als Berichtsfonds nach den britischen Offshore-Fonds-Regelungen zugelassen (oder, sofern nicht anders angegeben, innerhalb einer angemessenen Frist nach seiner Genehmigung durch die Zentralbank). Als berichtende Fonds wird die Gesellschaft für gewöhnlich keine Dividenden beschließen, kann dies aber nach Ermessen des Verwaltungsrats zu einem bestimmten Datum tun. Der Verwaltungsrat kann von Zeit zu Zeit Anteilklassen mit unterschiedlichen Ausschüttungsrichtlinien auflegen. Dividenden, sofern gezahlt, werden (falls in einem entsprechenden fondsspezifischen Prospektnachtrag nicht anders angegeben) in der Basiswährung des jeweiligen Fonds deklariert.

30. Juni 2020		
Fonds	Ex-Tag	Dividendensatz
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>		
USD Distributing ETF	12. September 2019	0,0955 \$
	12. Dezember 2019	0,0935 \$
	12. März 2020	0,0938 \$
	11. Juni 2020	0,0569 \$

30. Juni 2019		
Fonds	Ex-Tag	Dividendensatz
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>		
USD Distributing ETF	13. September 2018	0,1059 \$
	13. Dezember 2018	0,0931 \$
	14. März 2019	0,1065 \$
	13. Juni 2019	0,0994 \$
<b>L&amp;G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF<sup>1</sup></b>		
EUR Distributing ETF	12. Juli 2018	0,0947 €
<b>L&amp;G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF<sup>1</sup></b>		
USD Distributing ETF	12. Juli 2018	0,1956 \$
GBP Hedged Distributing ETF	12. Juli 2018	0,0479 £
	11. Oktober 2018	0,0502 £
	10. Januar 2019	0,0526 £
<b>L&amp;G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF<sup>1</sup></b>		
USD Distributing ETF	12. Juli 2018	0,1235 \$
<b>L&amp;G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF<sup>1</sup></b>		
GBP Hedged Distributing ETF	12. Juli 2018	1,1189 £
<b>L&amp;G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF<sup>1</sup></b>		
USD Distributing ETF	12. Juli 2018	0,5286 \$

<sup>1</sup> 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.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 15. Getrennte Haftung

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

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

#### 16. Nettoinventarwert

Die folgende Tabelle fasst den Nettoinventarwert, die in Umlauf befindlichen Anteile und den NIW je Anteil am Ende der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2020, 30. Juni 2019 und 30. Juni 2018 zusammen.

Fonds	Währung	NIW zum 30. Juni 2020 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2020 Je Anteil
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	US\$	27.517.011	1.730.000	15,9057
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	EUR	30.354.290	120.209	252,5126
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	EUR	67.772.133	21.633.366	3,1327
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	US\$	439.243.546	36.093.787	12,1695
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	GBP	12.487.709	57.885	215,7330
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	GBP	26.073.456	3.349.704	7,7838
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	US\$	48.856.605	803.767	60,7845
L&G Gold Mining UCITS ETF	US\$	273.800.641	7.562.093	36,2069
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	US\$	13.578.782	4.911.066	2,7649
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	US\$	816.606.435	47.430.616	17,2168
L&G Cyber Security UCITS ETF	US\$	1.547.753.663	81.536.776	18,9822
L&G All Commodities UCITS ETF	US\$	50.460.470	6.191.310	8,1502
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	US\$	7.801.655	791.187	9,8606
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	US\$	111.264.445	12.150.000	9,1575
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	US\$	25.643.912	2.150.000	11,9274
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	US\$	58.987.801	5.550.000	10,6284
L&G US Equity UCITS ETF	US\$	137.286.308	11.767.267	11,6667
L&G UK Equity UCITS ETF	GBP	10.962.695	1.200.000	9,1355
L&G Japan Equity UCITS ETF	US\$	116.469.371	11.185.000	10,4129
L&G Global Equity UCITS ETF	US\$	32.552.079	2.900.000	11,2248



## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 16. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle fasst den Nettoinventarwert, die in Umlauf befindlichen Anteile und den NIW je Anteil am Ende der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2020, 30. Juni 2019 und 30. Juni 2018 zusammen.

Fonds	Währung	NIW zum 30. Juni 2020 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2020 Je Anteil
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	EUR	99.876.259	9.360.988	10,6694
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	US\$	47.377.214	4.605.639	10,2867
L&G Clean Water UCITS ETF	US\$	15.520.613	1.500.000	10,3470
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	US\$	82.834.267	6.496.000	12,7515
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	US\$	33.256.148	2.650.000	12,5494
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup>	EUR	92.898.894	9.200.000	10,0977
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>2</sup>	US\$	602.438.807	57.400.000	10,4954

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

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 Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 16. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle fasst den Nettoinventarwert, die in Umlauf befindlichen Anteile und den NIW je Anteil am Ende der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2020, 30. Juni 2019 und 30. Juni 2018 zusammen.

Fonds	Währung	NIW zum 30. Juni 2018 Gesamt	Anteile im Umlauf	NIW zum 30. Juni 2018 Je Anteil
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	US\$	20.352.408	1.480.000	13,7516
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	EUR	33.130.560	113.666	291,4729
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	EUR	78.174.952	16.678.036	4,6872
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	US\$	882.075.669	59.909.437	14,7234
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	GBP	7.068.884	21.604	327,2025
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	GBP	18.633.818	2.421.635	7,6947
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	US\$	54.250.917	796.088	68,1468
L&G Gold Mining UCITS ETF	US\$	191.506.566	8.808.689	21,7406
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	US\$	30.119.528	5.511.066	5,4652
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	US\$	1.202.590.627	76.740.500	15,6708
L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF: EUR Distributing ETF	EUR	14.700.397	1.444.709	10,1753
L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF: USD Distributing ETF	US\$	35.174.957	3.423.063	10,2758
L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF: GBP Hedged Distributing ETF	GBP	58.708.294	5.709.309	10,2829
L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF: GBP Hedged Distributing ETF	GBP	1.784.623	185.636	9,6135
L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF: EUR Hedged Distributing ETF	EUR	22.276.559	2.300.000	9,6854
L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF: USD Distributing ETF	US\$	11.980.646	1.205.808	9,9357
L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF: USD Distributing ETF	US\$	256.845.384	25.118.400	10,2253
L&G Cyber Security UCITS ETF	US\$	642.041.827	46.197.776	13,8976
L&G All Commodities UCITS ETF	US\$	21.786.295	2.050.000	10,6274
L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF	US\$	38.235.287	3.190.000	11,9859
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	US\$	27.792.947	3.210.000	8,6582
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	US\$	2.972.122	300.000	9,9070
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	US\$	2.912.169	300.000	9,7072

#### 17. Segmentberichterstattung

Ein Geschäftssegment ist eine Komponente der Gesellschaft, die Geschäfte tätigt, aus denen sie Erträge erzielen kann und aus denen ihr Aufwendungen entstehen können, u. a. Erträge und Aufwendungen, die sich auf Transaktionen mit anderen Komponenten der Gesellschaft beziehen, deren operative Ergebnisse regelmäßig überprüft werden, um Entscheidungen über diesem Segment zuzuordnende Ressourcen zu treffen und seine Leistung zu beurteilen, und für das getrennte Finanzinformationen zur Verfügung stehen.

Zu den ausgewiesenen Segmentergebnissen gehören Posten, die direkt einem Segment zuzuordnen sind.

Jeder Fonds gilt als Geschäftssegment, das seinem Anlageziel entsprechend Anlagen tätigt. Die dem Verwaltungsrat der Gesellschaft gelieferten Segmentinformationen sind dieselben wie die in der Gesamtergebnisrechnung und in der Bilanz der einzelnen Fonds angegebenen. Als Hauptentscheidungsträger, der für die Zuteilung von Ressourcen und die Beurteilung der Performance der Geschäftssegmente zuständig ist, ist der Verwaltungsrat bestimmt worden.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 17. Segmentberichterstattung (Fortsetzung)

##### Geografische Angaben

Die Entscheidungen des Anlageverwalters in Bezug auf die Portfoliostrukturierung basieren auf einer einzigen, integrierten Anlagestrategie, um die Wertentwicklung des jeweiligen Index der einzelnen Fonds zu erzielen, und die Wertentwicklung der einzelnen Fonds wird unter Bezugnahme auf den jeweiligen Index bewertet. Die Fonds haben keine Vermögenswerte, die als langfristig einzustufen sind. Die Anlagen der einzelnen Fonds setzen diese der Wertentwicklung des jeweiligen Index aus. Die Fonds haben keine Vermögenswerte, die als langfristig einzustufen sind. Die Anlagen der einzelnen Fonds setzen diese der Wertentwicklung des jeweiligen Index aus. Der dem einzelnen Fonds zuzuordnende Ertrag leitet sich aus geografischen Standorten (d. h. das Gründungsland des Emittenten der Instrumente) entsprechend den in der Aufstellung der Vermögenswerte für die Fonds mit physischer Nachbildung angegebenen ab. Die täglichen Entscheidungen in Bezug auf die Portfoliostrukturierung werden vom Anlageverwalter für die einzelnen Fonds getroffen. Bei den Fonds mit synthetischer Nachbildung werden die Erlöse, die den umgekehrten Pensionsgeschäften und den Geldmarktinstrumenten zuzurechnen sind, vom Gründungsland des Emittenten der Instrumente abgeleitet; bei den Swap-Kontrakten erfolgt keine spezifische Länderallokation.

Die Gesellschaft ist in Irland ansässig. Sämtliche Erträge der Gesellschaft aus Anlagen stammen in erster Linie von Unternehmen, die in anderen Ländern als Irland gegründet wurden. Die Aufschlüsselung der wichtigsten Komponenten der Erträge aus anderen Ländern ist nachstehend angegeben.

	Vereinigtes Königreich \$	Rest Europas \$	Vereinigte Staaten \$	Japan \$	Rest der Welt \$	Insgesamt \$
Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020						
Nettoertrag nach Segmenten*	8.401.018	(2.022.240)	238.763.969	15.419.680	10.951.640	271.514.067

	Vereinigtes Königreich \$	Rest Europas \$	Vereinigte Staaten \$	Japan \$	Rest der Welt \$	Insgesamt \$
Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019						
Nettoertrag nach Segmenten*	(21.452.665)	54.770.119	77.744.053	(6.180.154)	3.674.886	108.556.239

\* Stellt die Erträge insgesamt abzüglich Zinsaufwendungen dar

##### Wichtige Kunden

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

Am 20. April 2020 erfolgte in der Gesellschaft die Umstellung auf das Abwicklungsmodell International Central Securities Depository (ICSD). Im Rahmen des ICSD-Abwicklungsmodell werden alle Anteilsbestände an der Gesellschaft im Anteilhaberregister der Gesellschaft im Namen eines einzigen rechtlichen Anteilhabers – The Bank of New York Depository (Nominees) Limited als das zum Nominee der gemeinsamen Verwahrstelle bestellte Unternehmen – eingetragen. Deshalb ist The Bank of New York Depository (Nominees) Limited ein wichtiger Kunde, der das rechtliche Eigentum an 100 % des ausgegebenen Anteilkapitals der Gesellschaft hält, nicht aber wirtschaftliche Eigentum.

Zur Identifizierung der wirtschaftlichen Eigentümer der Anteile an der Gesellschaft erhält die Gesellschaft Teilnehmerberichte von der ICSD, in denen das wirtschaftliche Eigentum an Anteilen an der Gesellschaft, die über das ICSD-Abwicklungsmodell gehalten werden, nachgewiesen wird (der „Teilnehmerbericht“). Allerdings erscheinen Endanleger, die Anteile an Börsen kaufen (d. h. die eigentlichen wirtschaftlichen Eigentümer), nicht im Teilnehmerbericht. Dies liegt daran, dass sie ihre Anteile in der Regel über einen Intermediär (Makler/Nominee oder eine lokale gemeinsame Verwahrstelle) halten, der an ihrer Stelle im Teilnehmerbericht verzeichnet ist.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 17. Segmentberichterstattung (Fortsetzung)

##### Wichtige Kunden (Fortsetzung)

Kaufen und verkaufen Endanleger ihre Anteile an Börsen, die lokale Clearing- und Abrechnungssysteme verwenden (z. B. Borsa Italiana), werden diese Endanleger in einem weiteren Schritt aus dem Teilnehmerbericht entfernt. Dies liegt daran, dass das jeweilige von einer bestimmten Börse genutzte Clearing- und Abrechnungssystem (zum Beispiel Monte Titoli für über die Borsa Italiana abgewickelte Transaktionen) in der Regel im Teilnehmerbericht für alle an der jeweiligen Börse getätigten Anlagen erscheint. Das ausländische Abrechnungssystem führt wiederum seine eigenen Aufzeichnungen zu den lokalen Intermediären (Makler/Nominees), die im Namen der Endanleger Anteile halten.

Es ist daher der Gesellschaft nicht möglich, alle Endanleger (d. h. wirtschaftlichen Eigentümer), die an Anteilen der Gesellschaft beteiligt sind, zu identifizieren. Ebenso ist es der Gesellschaft nicht möglich, genau zu quantifizieren, wie viele Endanleger es für eine bestimmte Anteilklasse der Gesellschaft gibt. Dementsprechend ist es der Gesellschaft nur möglich, den einzigen rechtlichen Anteilinhaber der Gesellschaft – The Bank of New York Depository (Nominees) Limited – zu identifizieren.

#### 18. Transaktionskosten

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

Die nachstehende Tabelle weist die Transaktionskosten für Fonds mit Anlagen in Stammaktien für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 aus.

	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020	Geschäftsjahr zum 30. Juni 2019
L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF	20.236 \$	19.850 \$
L&G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF	247.675 \$	365.405 \$
L&G Cyber Security UCITS ETF	739.114 \$	625.506 \$
L&G Battery Value-Chain UCITS ETF	76.830 \$	11.138 \$
L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF	9.823 \$	5.473 \$
L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF	26.189 \$	2.325 \$
L&G US Equity UCITS ETF	3.665 \$	4.400 \$
L&G UK Equity UCITS ETF	17.249 £	44.633 £
L&G Japan Equity UCITS ETF	3.506 \$	4.763 \$
L&G Global Equity UCITS ETF	3.349 \$	13.252 \$
L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF	11.663 €	149.703 €
L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF	12.488 \$	10.960 \$
L&G Clean Water UCITS ETF	11.904 \$	985 \$
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	23.724 \$	449 \$
L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF	5.301 \$	242 \$
L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>1</sup>	423.727 €	Nicht zutreffend
L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF <sup>2</sup>	64.925 \$	Nicht zutreffend

<sup>1</sup> Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

<sup>2</sup> Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 19. Eventualverbindlichkeiten und Verpflichtungen

Es bestanden mit Ausnahme der im Abschluss offen gelegten zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 keine wesentlichen Eventualverbindlichkeiten oder Verpflichtungen.

#### 20. Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres

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

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

L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF wurde am 6. August 2019 von der Zentralbank zugelassen und am 17. September 2019 an der Londoner Börse (London Stock Exchange) sowie am 20. November 2019 an der Borsa Italiana und am 27. Januar 2020 an der Frankfurter Börse gelistet.

Am 4. September 2019 erhielten die im Anteilinhaberregister 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 Emerging Markets Equity UCITS ETF wurde am 15. Oktober 2019 von der Zentralbank zugelassen.

Der L&G US Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF wurde am 6. November 2019 von der Zentralbank zugelassen und am 10. Dezember 2019 an der Londoner Börse (London Stock Exchange) sowie am 27. Januar 2020 an der Frankfurter Börse und der Borsa Italiana gelistet.

Am 1. Dezember 2019 ersetzte The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, die BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited als die Verwahrstelle der Gesellschaft.

Am 14. Januar 2020 wurde Herr Feargal Dempsey als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

Am 23. März 2020 wurde Herr Howie Li als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

Am 23. März 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für den L&G LOIM Euro Government Bond Fundamental UCITS ETF.

Mark Weeks hat sein Amt als Mitglied des Verwaltungsrats der Gesellschaft am 31. März 2020 niedergelegt.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

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

Mit Wirkung vom 31. März 2020 ersetzte die LGIM Managers (Europe) Limited (die „neue Verwaltungsgesellschaft“) die LGIM ETF Managers Limited als Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft. Die neue Verwaltungsgesellschaft mit eingetragener Adresse in 33/34 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland, wurde am 14. August 2017 in Irland als Gesellschaft mit beschränkter Haftung gegründet. Sie ist von der Zentralbank als AIFM gemäß den AIFM-Vorschriften und als OGAW-Verwaltungsgesellschaft gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen und untersteht deren Aufsicht. Die maßgeblichen Aktualisierungen im Verkaufsprospekt der Gesellschaft wurden anschließend am 20. April 2020 von der Zentralbank zur Kenntnis genommen, in Übereinstimmung mit der Aktualisierung des Verkaufsprospekts zur Berücksichtigung der Umstellung der Gesellschaft auf das Abwicklungsmodell International Central Securities Depository (das „ICSD“-Modell“).

Mit Wirkung vom 20. April 2020 führte die Gesellschaft das ICSD-Abwicklungsmodell ein, das eine zentralisierte Abwicklung für an mehreren Börsen durchgeführte Transaktionen ermöglicht. Der Verkaufsprospekt der Gesellschaft, die Fondssatzung sowie alle Nachträge wurden am 20. April 2020 aktualisiert, um den Übergang auf das ICSD-Abwicklungsmodell zu berücksichtigen.

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 bisherige Abschlussprüfer der Gesellschaft („KPMG“) die maximal zulässige Zeitspanne tätig gewesen war, war die Gesellschaft verpflichtet, ab der gesetzlichen Abschlussprüfung im Jahr 2020 eine neue Prüfungsgesellschaft zu bestellen. Nach einer vom Prüfungsausschuss durchgeführten Überprüfung von Prüfungsgesellschaften wurde EY mit einem Wirksamkeitsdatum vom 1. April 2020 zum Abschlussprüfer der Gesellschaft bestellt. KPMG wurde am 1. April 2020 als Abschlussprüfer der Gesellschaft abgelöst.

Am 5. Juni 2020 wurden die folgenden Fonds an der Swiss SIX Exchange gelistet:

- L&G Clean Water UCITS ETF
- L&G Artificial Intelligence UCITS ETF
- L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF
- L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF
- L&G Battery Value-Chain UCITS ETF
- L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

Am 23. Juni 2020 wurde Frau Patrizia Libotte als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

#### COVID-19

Seit Januar 2020 sind die globalen Finanzmärkte vom Coronavirus („COVID-19“) betroffen. COVID-19 hat zu erheblichen Unsicherheiten geführt und Störungen in der Wirtschaft und in unserem Alltag verursacht. Die Finanzmärkte haben auf diese Meldungen heftig reagiert; es machten sich Sorgen bezüglich der möglichen weltweiten Auswirkungen der Pandemie auf die Konjunktur breit. Die langfristigen Auswirkungen auf die Weltwirtschaft und die globalen Märkte hängt von der generellen Größenordnung und der Dauer des Ausbruchs sowie von den Maßnahmen von staatlicher Seite und vonseiten der Zentralbanken ab. Der Verwaltungsrat beobachtet kontinuierlich die Lage und sowohl die Verwaltungsgesellschaft als auch der Anlageverwalter haben ihre jeweilige Geschäftskontinuitätsplanung umgesetzt.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse im Geschäftsjahr.

## Anmerkungen zum Jahresabschluss (Fortsetzung)

### Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 (Fortsetzung)

#### 21. Wesentliche Ereignisse nach Ablauf des Geschäftsjahres

Am 16. Juli 2020 wurde David Fagan als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

Am 1. September 2020 bestätigte die Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung für die folgenden Fonds der Gesellschaft:

- L&G LOIM Euro Corporate Bond Fundamental UCITS ETF;
- L&G LOIM Global Corporate Bond Fundamental UCITS ETF;
- L&G LOIM Global Government Bond Fundamental UCITS ETF; und
- L&G LOIM Emerging Market Local Government Bond Fundamental UCITS ETF.

Am 11. September 2020 wurde Feargal Dempsey zum Vorsitzenden des Verwaltungsrats der Gesellschaft ernannt.

Am 11. September 2020 wurden die folgenden neuen Fonds der Gesellschaft von der Zentralbank zugelassen:

- L&G ESG GBP Corporate Bond 0-5 Year UCITS ETF;
- L&G ESG GBP Corporate Bond UCITS ETF;
- L&G ESG Emerging Markets Government Bond (USD) 0-5 Year UCITS ETF;
- L&G ESG China CNY Bond UCITS ETF; und
- L&G UK Gilt 0-5 Year UCITS ETF.

#### 22. Genehmigung des Jahresabschlusses

Der Verwaltungsrat hat den geprüften Abschluss am 16. Oktober 2020 genehmigt.

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %)</b>			
<b>Cayman-Inseln</b>			
2.600	China Resources Microelectronics Ltd 'A'	15.966	0,06
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>15.966</b>	<b>0,06</b>
<b>China</b>			
8.200	360 Security Technology Inc 'A'	21.224	0,08
7.300	Accelink Technologies Co Ltd 'A'	33.909	0,12
10.600	Addsino Co Ltd 'A'	20.483	0,07
11.023	AECC Aviation Power Co Ltd 'A'	36.587	0,13
258.915	Agricultural Bank of China Ltd 'A'	123.710	0,45
18.421	Aier Eye Hospital Group Co Ltd 'A'	113.144	0,41
24.700	Air China Ltd 'A'	23.080	0,08
16.300	Aisino Corp 'A'	37.420	0,14
69.600	Aluminum Corp of China Ltd 'A'	27.155	0,10
5.600	Angel Yeast Co Ltd 'A'	39.169	0,14
20.150	Anhui Anke Biotechnology Group Co Ltd 'A'	50.987	0,19
19.763	Anhui Conch Cement Co Ltd 'A'	147.815	0,54
1.300	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'A'	27.609	0,10
22.448	Anhui Jianghuai Automobile Group Corp Ltd 'A'	28.020	0,10
4.800	Anhui Kouzi Distillery Co Ltd 'A'	34.537	0,13
15.512	Anhui Zhongding Sealing Parts Co Ltd 'A'	17.213	0,06
8.500	Apeloa Pharmaceutical Co Ltd 'A'	27.984	0,10
500	Archermind Technology Nanjing Co Ltd 'A'	13.387	0,05
1.000	Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd 'A'	34.351	0,12
1.000	Autobio Diagnostics Co Ltd 'A'	22.963	0,08
2.600	Avary Holding Shenzhen Co Ltd 'A'	18.399	0,07
14.174	AVIC Aircraft Co Ltd 'A'	35.545	0,13
45.100	Avic Capital Co Ltd 'A'	25.246	0,09
23.775	AVIC Electromechanical Systems Co Ltd 'A'	26.551	0,10



## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
6.887	AVIC Jonhon Optronic Technology Co Ltd 'A'	39.925	0,15
3.900	AVIC Shenyang Aircraft Co Ltd 'A'	18.094	0,07
4.497	AVICOPTER Plc 'A'	26.108	0,09
122.644	Bank of Beijing Co Ltd 'A'	84.952	0,31
20.400	Bank of Chengdu Co Ltd 'A'	22.955	0,08
131.700	Bank of China Ltd 'A'	64.788	0,24
190.360	Bank of Communications Co Ltd 'A'	138.046	0,50
29.820	Bank of Guiyang Co Ltd 'A'	30.182	0,11
20.000	Bank of Hangzhou Co Ltd 'A'	25.219	0,09
99.200	Bank of Jiangsu Co Ltd 'A'	79.510	0,29
60.923	Bank of Nanjing Co Ltd 'A'	63.127	0,23
23.200	Bank of Ningbo Co Ltd 'A'	86.154	0,31
72.160	Bank of Shanghai Co Ltd 'A'	84.665	0,31
65.429	Baoshan Iron & Steel Co Ltd 'A'	42.176	0,15
29.300	BBMG Corp 'A'	12.674	0,05
5.000	Beijing BDStar Navigation Co Ltd 'A'	22.639	0,08
34.890	Beijing Capital Co Ltd 'A'	14.846	0,05
26.093	Beijing Capital Development Co Ltd 'A'	21.615	0,08
21.646	Beijing Dabeinong Technology Group Co Ltd 'A'	27.876	0,10
3.960	Beijing E-Hualu Information Technology Co Ltd 'A'	31.348	0,11
10.100	Beijing Enlight Media Co Ltd 'A'	15.577	0,06
4.891	Beijing Gehua CATV Network Co Ltd 'A'	10.509	0,04
15.500	Beijing Jetsen Technology Co Ltd 'A'	8.742	0,03
600	Beijing Kingsoft Office Software Inc 'A'	28.972	0,11
11.200	Beijing Kunlun Tech Co Ltd 'A'	39.518	0,14
8.000	Beijing New Building Materials Plc 'A'	24.122	0,09
10.800	Beijing Orient National Communication Science & Technology Co Ltd 'A'	18.946	0,07
11.120	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd 'A'	63.868	0,23

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
21.000	Beijing Originwater Technology Co Ltd 'A'	24.105	0,09
12.000	Beijing Sanju Environmental Protection and New Material Co Ltd 'A'	7.260	0,03
2.500	Beijing Shiji Information Technology Co Ltd 'A'	13.793	0,05
4.810	Beijing Shunxin Agriculture Co Ltd 'A'	38.743	0,14
11.100	Beijing Sinnet Technology Co Ltd 'A'	40.907	0,15
13.500	Beijing SL Pharmaceutical Co Ltd 'A'	24.446	0,09
5.900	Beijing Thunisoft Corp Ltd 'A'	23.528	0,09
3.900	Beijing Tiantan Biological Products Corp Ltd 'A'	24.991	0,09
7.200	Beijing Tongrentang Co Ltd 'A'	27.603	0,10
28.270	Beijing Urban Construction Investment & Development Co Ltd 'A'	20.261	0,07
26.410	Beijing Yanjing Brewery Co Ltd 'A'	25.573	0,09
24.300	Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd 'A'	21.400	0,08
75.500	Beiqi Foton Motor Co Ltd 'A'	19.211	0,07
1.400	Betta Pharmaceuticals Co Ltd 'A'	27.703	0,10
1.300	BGI Genomics Co Ltd 'A'	28.651	0,10
286.856	BOE Technology Group Co Ltd 'A'	189.369	0,69
9.207	BYD Co Ltd 'A'	93.448	0,34
11.300	By-health Co Ltd 'A'	31.452	0,11
8.200	C&S Paper Co Ltd 'A'	25.849	0,09
20.600	Caitong Securities Co Ltd 'A'	29.848	0,11
19.500	Centre Testing International Group Co Ltd 'A'	54.469	0,20
3.000	Chacha Food Co Ltd 'A'	22.981	0,08
2.450	Changchun High & New Technology Industry Group Inc 'A'	150.759	0,55
37.700	Changjiang Securities Co Ltd 'A'	35.920	0,13
1.400	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd 'A'	25.134	0,09
12.200	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd 'A'	47.771	0,17
3.400	Chengdu Kanghong Pharmaceutical Group Co Ltd 'A'	23.839	0,09
32.736	Chengdu Xingrong Environment Co Ltd 'A'	21.287	0,08

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
28.500	Chengtun Mining Group Co Ltd 'A'	20.708	0,08
27.456	China Aerospace Times Electronics Co Ltd 'A'	24.995	0,09
21.228	China Baoan Group Co Ltd 'A'	25.537	0,09
19.228	China CITIC Bank Corp Ltd 'A'	13.998	0,05
15.100	China Communications Construction Co Ltd 'A'	15.668	0,06
76.460	China Construction Bank Corp 'A'	68.201	0,25
4.500	China CSSC Holdings Ltd 'A'	11.094	0,04
25.928	China Eastern Airlines Corp Ltd 'A'	15.467	0,06
115.400	China Everbright Bank Co Ltd 'A'	58.401	0,21
6.300	China Film Co Ltd 'A'	11.693	0,04
44.000	China First Heavy Industries 'A'	17.478	0,06
9.074	China Fortune Land Development Co Ltd 'A'	29.323	0,11
17.300	China Galaxy Securities Co Ltd 'A'	28.050	0,10
33.100	China Gezhouba Group Co Ltd 'A'	27.840	0,10
22.300	China Grand Automotive Services Group Co Ltd 'A'	10.056	0,04
7.000	China Great Wall Securities Co Ltd 'A'	12.191	0,04
14.449	China Greatwall Technology Group Co Ltd 'A'	26.961	0,10
11.165	China International Marine Containers Group Co Ltd 'A'	11.411	0,04
26.990	China Jushi Co Ltd 'A'	34.910	0,13
11.906	China Life Insurance Co Ltd 'A'	45.796	0,17
8.735	China Meheco Co Ltd 'A'	17.472	0,06
143.827	China Merchants Bank Co Ltd 'A'	685.579	2,49
16.759	China Merchants Energy Shipping Co Ltd 'A'	13.812	0,05
20.343	China Merchants Securities Co Ltd 'A'	63.122	0,23
21.512	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd 'A'	49.993	0,18
221.046	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A'	177.172	0,64
77.800	China Molybdenum Co Ltd 'A'	40.362	0,15
1.800	China National Accord Medicines Corp Ltd 'A'	11.453	0,04

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
21.000	China National Chemical Engineering Co Ltd 'A'	16.268	0,06
1.724	China National Medicines Corp Ltd 'A'	9.912	0,04
59.500	China National Nuclear Power Co Ltd 'A'	34.401	0,13
2.700	China National Software & Service Co Ltd 'A'	30.229	0,11
21.002	China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd 'A'	27.670	0,10
25.565	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'A'	98.479	0,36
101.109	China Petroleum & Chemical Corp 'A'	55.885	0,20
48.144	China Railway Construction Corp Ltd 'A'	57.032	0,21
81.400	China Railway Group Ltd 'A'	57.764	0,21
11.600	China Railway Hi-tech Industry Co Ltd 'A'	14.463	0,05
13.700	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'A'	12.414	0,05
8.200	China Reform Health Management and Services Group Co Ltd 'A'	12.913	0,05
7.200	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd 'A'	29.710	0,11
23.614	China Shenhua Energy Co Ltd 'A'	47.935	0,17
79.300	China Shipbuilding Industry Co Ltd 'A'	44.840	0,16
7.400	China Shipbuilding Industry Group Power Co Ltd 'A'	16.423	0,06
7.700	China South Publishing & Media Group Co Ltd 'A'	11.516	0,04
28.597	China Southern Airlines Co Ltd 'A'	20.900	0,08
5.200	China Spacesat Co Ltd 'A'	22.662	0,08
213.232	China State Construction Engineering Corp Ltd 'A'	143.780	0,52
9.658	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd 'A'	210.292	0,76
7.900	China TransInfo Technology Co Ltd 'A'	26.791	0,10
108.259	China United Network Communications Ltd 'A'	74.069	0,27
69.461	China Vanke Co Ltd 'A'	256.670	0,93
1.200	China Wafer Level CSP Co Ltd 'A'	13.343	0,05
19.200	China XD Electric Co Ltd 'A'	13.136	0,05
80.584	China Yangtze Power Co Ltd 'A'	215.754	0,78
5.300	Chinese Universe Publishing and Media Group Co Ltd 'A'	8.826	0,03

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
3.400	Chongqing Brewery Co Ltd 'A'	35.086	0,13
21.096	Chongqing Changan Automobile Co Ltd 'A'	32.804	0,12
5.600	Chongqing Department Store Co Ltd 'A'	24.714	0,09
5.700	Chongqing Fuling Zhacai Group Co Ltd 'A'	29.015	0,11
3.800	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd 'A'	53.798	0,20
39.270	CITIC Guoan Information Industry Co Ltd 'A'	13.212	0,05
86.519	CITIC Securities Co Ltd 'A'	294.875	1,07
19.000	CMST Development Co Ltd 'A'	11.791	0,04
13.600	COFCO Tunhe Sugar Co Ltd 'A'	14.957	0,05
8.700	Contemporary Ampere Technology Co Ltd 'A'	214.435	0,78
60.180	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'A'	15.653	0,06
18.700	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'A'	17.077	0,06
45.156	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'A'	22.150	0,08
109.436	CRRC Corp Ltd 'A'	86.168	0,31
9.400	CSC Financial Co Ltd 'A'	52.328	0,19
6.270	Da An Gene Co Ltd of Sun Yat-Sen University 'A'	24.179	0,09
68.020	Dalian Port PDA Co Ltd 'A**	16.538	0,06
72.834	Daqin Railway Co Ltd 'A'	72.483	0,26
10.684	Dawning Information Industry Co Ltd 'A'	57.995	0,21
15.068	DHC Software Co Ltd 'A'	26.668	0,10
3.900	Dian Diagnostics Group Co Ltd 'A'	19.461	0,07
3.700	Digital China Group Co Ltd 'A'	12.731	0,05
5.427	Dong-E-E-Jiao Co Ltd 'A'	27.472	0,10
23.600	Dongfang Electric Corp Ltd 'A'	29.525	0,11
14.800	Dongxing Securities Co Ltd 'A'	22.804	0,08
71.000	East Money Information Co Ltd 'A'	202.740	0,74
10.200	Eastern Communications Co Ltd 'A'	21.758	0,08
26.000	Elion Clean Energy Co Ltd 'A'	11.982	0,04

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
3.300	Eoptolink Technology Inc Ltd 'A'	29.445	0,11
13.224	Eve Energy Co Ltd 'A'	89.449	0,33
18.800	Everbright Securities Co Ltd 'A'	42.681	0,16
25.950	Fangda Carbon New Material Co Ltd 'A'	23.037	0,08
15.198	Fangda Special Steel Technology Co Ltd 'A'	11.150	0,04
17.401	FAW Jiefang Group Co Ltd 'A'	26.418	0,10
7.129	Fiberhome Telecommunication Technologies Co Ltd 'A'	29.134	0,11
30.000	Financial Street Holdings Co Ltd 'A'	28.159	0,10
24.200	First Capital Securities Co Ltd 'A'	23.673	0,09
110.280	Focus Media Information Technology Co Ltd 'A'	86.832	0,32
10.260	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A'	180.425	0,66
42.865	Founder Securities Co Ltd 'A'	42.901	0,16
16.800	Foxconn Industrial Internet Co Ltd 'A'	35.979	0,13
12.447	Fujian Longking Co Ltd 'A'	15.484	0,06
4.200	Fujian Star-net Communication Co Ltd 'A'	20.976	0,08
5.400	Fujian Sunner Development Co Ltd 'A'	22.137	0,08
13.417	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'A'	39.583	0,14
7.050	Ganfeng Lithium Co Ltd 'A'	53.388	0,19
300	G-bits Network Technology Xiamen Co Ltd 'A'	23.283	0,08
22.600	GCL System Integration Technology Co Ltd 'A'	8.338	0,03
158.363	GD Power Development Co Ltd 'A'	41.415	0,15
43.420	GEM Co Ltd 'A'	30.505	0,11
20.638	Gemdale Corp 'A'	39.968	0,15
28.500	GF Securities Co Ltd 'A'	56.886	0,21
8.000	Giant Network Group Co Ltd 'A'	19.677	0,07
3.340	Gigadevice Semiconductor Beijing Inc 'A'	111.384	0,40
9.100	Global Top E-Commerce Co Ltd 'A'	8.349	0,03
7.908	Glodon Co Ltd 'A'	77.916	0,28

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
21.670	GoerTek Inc 'A'	89.938	0,33
9.900	Gotion High-tech Co Ltd 'A'	37.562	0,14
7.100	Grandblue Environment Co Ltd 'A'	21.960	0,08
12.200	Grandjoy Holdings Group Co Ltd 'A'	8.778	0,03
16.900	Greatown Holdings Ltd 'A'	14.215	0,05
49.172	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai 'A'	393.218	1,43
29.500	Greenland Holdings Corp Ltd 'A'	25.772	0,09
13.200	GRG Banking Equipment Co Ltd 'A'	24.146	0,09
28.500	Guangdong Baolihua New Energy Stock Co Ltd 'A'	19.016	0,07
8.900	Guangdong Fenghua Advanced Technology Holding Co Ltd 'A'	36.724	0,13
6.844	Guangdong Golden Dragon Development Inc 'A'	12.093	0,04
6.200	Guangdong Haid Group Co Ltd 'A'	41.710	0,15
12.700	Guangdong HEC Technology Holding Co Ltd 'A'	12.405	0,05
4.700	Guangdong Hongda Blasting Co Ltd 'A'	23.187	0,08
12.400	Guangdong Tapai Group Co Ltd 'A'	21.087	0,08
57.980	Guanghui Energy Co Ltd 'A'	22.129	0,08
42.434	Guangshen Railway Co Ltd 'A'	13.497	0,05
40.404	Guangxi Wuzhou Zhongheng Group Co Ltd 'A'	18.334	0,07
17.900	Guangzhou Baiyun International Airport Co Ltd 'A'	38.563	0,14
3.839	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'A'	17.545	0,06
19.400	Guangzhou Haige Communications Group Inc Co 'A'	35.487	0,13
2.000	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd 'A'	25.304	0,09
2.100	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd 'A'	29.543	0,11
1.800	Guangzhou Wondfo Biotech Co Ltd 'A'	26.463	0,10
11.600	Guosen Securities Co Ltd 'A'	18.530	0,07
47.000	Guotai Junan Securities Co Ltd 'A'	114.675	0,42
22.777	Guoyuan Securities Co Ltd 'A'	27.046	0,10
38.600	Haier Smart Home Co Ltd 'A'	96.581	0,35

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
98.700	Hainan Airlines Holding Co Ltd 'A'	20.928	0,08
2.100	Hainan Poly Pharm Co Ltd 'A'	21.953	0,08
62.085	Haitong Securities Co Ltd 'A'	110.407	0,40
4.100	Hang Zhou Great Star Industrial Co Ltd 'A'	6.885	0,03
41.247	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd 'A'	176.962	0,64
7.100	Hangzhou Robam Appliances Co Ltd 'A'	31.224	0,11
10.700	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd 'A'	22.204	0,08
5.250	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'A'	75.610	0,27
6.805	Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A'	34.582	0,13
10.680	Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co Ltd 'A'	32.459	0,12
2.700	Hefei Meiya Optoelectronic Technology Inc 'A'	20.076	0,07
7.048	Henan Pinggao Electric Co Ltd 'A'	7.393	0,03
10.317	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd 'A'	67.219	0,24
19.040	Hengli Petrochemical Co Ltd 'A'	37.681	0,14
13.380	Hengtong Optic-electric Co Ltd 'A'	31.038	0,11
23.660	Hengyi Petrochemical Co Ltd 'A'	30.536	0,11
35.172	Hesteel Co Ltd 'A'	10.143	0,04
1.900	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd 'A'	35.743	0,13
16.200	HLA Corp Ltd 'A'	13.328	0,05
21.900	Holitech Technology Co Ltd 'A'	16.253	0,06
5.400	Hongfa Technology Co Ltd 'A'	30.626	0,11
6.400	Huaan Securities Co Ltd 'A'	6.179	0,02
9.258	Huadong Medicine Co Ltd 'A'	33.111	0,12
16.420	Huafa Industrial Co Ltd Zhuhai 'A'	16.387	0,06
16.758	Huafon Microfibre Shanghai Technology Co Ltd 'A'	20.278	0,07
11.156	Huagong Tech Co Ltd 'A'	38.527	0,14
10.265	Hualan Biological Engineering Inc 'A'	72.713	0,26
19.477	Huaneng Power International Inc 'A'	11.619	0,04



## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
54.667	Huatai Securities Co Ltd 'A'	145.282	0,53
18.600	Huaxi Securities Co Ltd 'A'	27.950	0,10
47.992	Huaxia Bank Co Ltd 'A'	41.519	0,15
7.000	Huaxin Cement Co Ltd 'A'	23.462	0,09
29.800	Huayi Brothers Media Corp 'A'	15.460	0,06
16.881	Huayu Automotive Systems Co Ltd 'A'	49.611	0,18
20.600	Hubei Biocause Pharmaceutical Co Ltd 'A'	15.172	0,06
9.800	Hubei Kaile Science & Technology Co Ltd 'A'	18.730	0,07
8.270	Humanwell Healthcare Group Co Ltd 'A'	31.822	0,12
42.420	Hunan Valin Steel Co Ltd 'A'	22.607	0,08
7.844	Hundsun Technologies Inc 'A'	119.421	0,43
18.200	Hytera Communications Corp Ltd 'A'	19.527	0,07
16.211	Iflytek Co Ltd 'A'	85.775	0,31
171.168	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A'	120.498	0,44
158.535	Industrial Bank Co Ltd 'A'	353.640	1,29
43.564	Industrial Securities Co Ltd 'A'	42.184	0,15
1.600	Ingenic Semiconductor Co Ltd 'A'	22.830	0,08
179.233	Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd 'A'	27.363	0,10
15.216	Inner Mongolia First Machinery Group Co Ltd 'A'	22.348	0,08
56.306	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A'	247.778	0,90
15.160	Inspur Electronic Information Industry Co Ltd 'A'	83.964	0,31
3.420	Jafron Biomedical Co Ltd 'A'	33.600	0,12
12.600	JCET Group Co Ltd 'A'	55.696	0,20
16.200	Jiangsu Broadcasting Cable Information Network Corp Ltd 'A'	8.611	0,03
31.800	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd 'A'	33.760	0,12
3.000	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd 'A'	34.011	0,12
29.016	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd 'A'	378.589	1,38
29.040	Jiangsu Jiangyin Rural Commercial Bank Co Ltd 'A'	16.133	0,06

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
5.900	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd 'A'	33.186	0,12
8.600	Jiangsu Nhwa Pharmaceutical Co Ltd 'A'	20.497	0,07
12.000	Jiangsu Shagang Co Ltd 'A'	21.204	0,08
4.500	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd 'A'	66.882	0,24
1.800	Jiangsu Yangnong Chemical Co Ltd 'A'	20.992	0,08
6.000	Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd 'A'	30.873	0,11
23.600	Jiangsu Zhongnan Construction Group Co Ltd 'A'	29.691	0,11
27.350	Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd 'A'	44.268	0,16
8.100	Jiangxi Copper Co Ltd 'A'	15.412	0,06
17.100	Jiangxi Zhengbang Technology Co Ltd 'A'	42.254	0,15
16.600	Jihua Group Corp Ltd 'A'	7.791	0,03
4.857	Jilin Aodong Pharmaceutical Group Co Ltd 'A'	10.800	0,04
40.024	Jilin Yatai Group Co Ltd 'A'	16.464	0,06
6.494	Jinduicheng Molybdenum Co Ltd 'A'	5.673	0,02
20.500	Jinke Properties Group Co Ltd 'A'	23.647	0,09
8.729	Jinyu Bio-Technology Co Ltd 'A'	34.353	0,12
10.900	Joicare Pharmaceutical Group Industry Co Ltd 'A'	25.023	0,09
7.200	Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd 'A'	18.951	0,07
6.000	Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding Co Ltd 'A'	49.643	0,18
3.900	Juewei Food Co Ltd 'A'	38.999	0,14
27.400	Kingfa Sci & Tech Co Ltd 'A'	51.011	0,19
5.887	Kweichow Moutai Co Ltd 'A'	1.217.396	4,42
11.100	Lens Technology Co Ltd 'A'	43.998	0,16
48.189	Leo Group Co Ltd 'A'	26.294	0,10
9.100	Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd 'A'	46.979	0,17
20.400	Leyard Optoelectronic Co Ltd 'A'	17.504	0,06
12.253	Liaoning Cheng Da Co Ltd 'A'	32.789	0,12
26.400	Lingyi iTech Guangdong Co 'A'	39.670	0,14

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
5.070	Livzon Pharmaceutical Group Inc 'A'	34.409	0,13
14.600	Lomon Billions Group Co Ltd 'A'	38.182	0,14
29.890	LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A'	172.096	0,63
13.700	Luxi Chemical Group Co Ltd 'A'	14.447	0,05
47.263	Luxshare Precision Industry Co Ltd 'A'	343.076	1,25
7.500	Luzhou Laojiao Co Ltd 'A'	96.606	0,35
39.400	Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'A'	14.370	0,05
2.800	Maccura Biotechnology Co Ltd 'A'	23.048	0,08
5.600	Mango Excellent Media Co Ltd 'A'	51.614	0,19
540	Maxscend Microelectronics Co Ltd 'A'	30.974	0,11
32.972	Meihua Holdings Group Co Ltd 'A'	21.161	0,08
27.960	Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd 'A'	56.955	0,21
73.900	Metallurgical Corp of China Ltd 'A'	26.221	0,10
54.142	Midea Group Co Ltd 'A'	457.606	1,66
24.700	Minmetals Capital Co Ltd 'A'	24.651	0,09
4.700	Montnets Rongxin Technology Group Co Ltd 'A'	13.155	0,05
14.004	Muyuan Foodstuff Co Ltd 'A'	162.329	0,59
12.200	NanJi E-Commerce Co Ltd 'A'	36.510	0,13
2.500	Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co Ltd 'A'	22.819	0,08
22.400	Nanjing Securities Co Ltd 'A'	45.186	0,16
9.900	Nanyang Topsec Technologies Group Inc 'A'	37.198	0,14
15.788	NARI Technology Co Ltd 'A'	45.194	0,16
2.500	NAURA Technology Group Co Ltd 'A'	60.400	0,22
14.925	NavInfo Co Ltd 'A'	34.791	0,13
12.700	Neusoft Corp 'A'	20.646	0,08
10.077	New China Life Insurance Co Ltd 'A'	63.077	0,23
16.300	New Hope Liuhe Co Ltd 'A'	68.665	0,25
12.000	Newland Digital Technology Co Ltd 'A'	27.107	0,10

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
5.500	Ninestar Corp 'A'	25.587	0,09
8.640	Ningbo Joyson Electronic Corp 'A'	29.081	0,11
15.080	Ningbo Shanshan Co Ltd 'A'	25.133	0,09
23.500	Ningbo Zhoushan Port Co Ltd 'A'	11.859	0,04
8.000	North China Pharmaceutical Co Ltd 'A'	14.577	0,05
8.688	North Navigation Control Technology Co Ltd 'A'	9.285	0,03
21.082	Northeast Securities Co Ltd 'A'	25.182	0,09
5.700	Offcn Education Technology Co Ltd 'A'	22.360	0,08
20.491	Offshore Oil Engineering Co Ltd 'A'	13.180	0,05
25.216	OFILM Group Co Ltd 'A'	65.552	0,24
700	Oppein Home Group Inc 'A'	11.469	0,04
23.900	ORG Technology Co Ltd 'A'	14.156	0,05
40.100	Orient Group Inc 'A'	25.055	0,09
31.100	Orient Securities Co Ltd/China 'A'	41.721	0,15
4.800	Oriental Energy Co Ltd 'A'	5.964	0,02
6.293	Oriental Pearl Group Co Ltd 'A'	8.584	0,03
3.000	Ovctek China Inc 'A'	29.406	0,11
73.737	Pacific Securities Co Ltd/The/China 'A'	33.043	0,12
18.520	PCI-Suntek Technology Co Ltd 'A'	23.850	0,09
4.700	People.cn Co Ltd 'A'	13.175	0,05
26.600	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'A'	24.216	0,09
5.200	Perfect World Co Ltd/China 'A'	42.370	0,15
66.883	PetroChina Co Ltd 'A'	39.615	0,14
97.100	Ping An Bank Co Ltd 'A'	175.695	0,64
99.998	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	1.009.296	3,67
75.059	Poly Developments and Holdings Group Co Ltd 'A'	156.822	0,57
35.900	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'A'	23.192	0,08
47.084	Power Construction Corp of China Ltd 'A'	23.029	0,08

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
35.100	Qingdao Rural Commercial Bank Corp 'A'	21.981	0,08
4.400	Qingdao TGOOD Electric Co Ltd 'A'	13.024	0,05
21.700	RiseSun Real Estate Development Co Ltd 'A'	24.847	0,09
13.000	Rongsheng Petro Chemical Co Ltd 'A'	22.604	0,08
28.247	SAIC Motor Corp Ltd 'A'	67.841	0,25
24.181	Sanan Optoelectronics Co Ltd 'A'	85.456	0,31
900	Sangfor Technologies Inc 'A'	26.203	0,10
6.150	Sansteel Minguang Co Ltd Fujian 'A'	5.790	0,02
67.082	Sany Heavy Industry Co Ltd 'A'	177.897	0,65
16.800	SDIC Capital Co Ltd 'A'	30.232	0,11
29.847	SDIC Power Holdings Co Ltd 'A'	33.163	0,12
39.950	Sealand Securities Co Ltd 'A'	24.510	0,09
7.700	Seazen Holdings Co Ltd 'A'	34.004	0,12
10.000	SF Holding Co Ltd 'A'	77.324	0,28
700	SG Micro Corp 'A'	30.185	0,11
29.100	Shaanxi Coal Industry Co Ltd 'A'	29.659	0,11
6.600	Shandong Buchang Pharmaceuticals Co Ltd 'A'	26.917	0,10
15.800	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'A'	11.034	0,04
11.810	Shandong Gold Mining Co Ltd 'A'	61.136	0,22
6.800	Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co Ltd 'A'	18.706	0,07
8.951	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd 'A'	22.371	0,08
123.000	Shandong Iron and Steel Co Ltd 'A'	22.430	0,08
105.088	Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd 'A'	30.156	0,11
3.300	Shandong Pharmaceutical Glass Co Ltd 'A'	27.056	0,10
9.700	Shandong Sinocera Functional Material Co Ltd 'A'	45.949	0,17
18.000	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd 'A'	24.224	0,09
50.000	Shandong Xinchao Energy Corp Ltd 'A'	10.743	0,04
53.300	Shanghai 2345 Network Holding Group Co Ltd 'A'	21.172	0,08

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
4.349	Shanghai AJ Group Co Ltd 'A'	4.887	0,02
9.129	Shanghai Bailian Group Co Ltd 'A'	18.647	0,07
3.900	Shanghai Baosight Software Co Ltd 'A'	32.571	0,12
30.274	Shanghai Construction Group Co Ltd 'A'	13.138	0,05
20.504	Shanghai Dazhong Public Utilities Group Co Ltd 'A'	13.217	0,05
39.100	Shanghai Electric Group Co Ltd 'A'	27.857	0,10
8.800	Shanghai Electric Power Co Ltd 'A'	9.205	0,03
10.000	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'A'	47.851	0,17
2.400	Shanghai Ganglian E-Commerce Holdings Co Ltd 'A'	26.666	0,10
10.778	Shanghai International Airport Co Ltd 'A'	109.805	0,40
20.484	Shanghai International Port Group Co Ltd 'A'	12.162	0,04
3.584	Shanghai Jahwa United Co Ltd 'A'	24.268	0,09
4.203	Shanghai M&G Stationery Inc 'A'	32.440	0,12
13.030	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'A'	33.855	0,12
162.333	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd 'A'	242.785	0,88
1.800	Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd 'A'	26.213	0,10
19.000	Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd 'A'	22.722	0,08
15.446	Shanghai SMI Holding Co Ltd 'A'	12.970	0,05
26.080	Shanghai Tunnel Engineering Co Ltd 'A'	20.830	0,08
9.100	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd 'A'	11.397	0,04
9.500	Shanghai Zhangjiang High-Tech Park Development Co Ltd 'A'	27.355	0,10
41.011	Shanghai Zhenhua Heavy Industries Co Ltd 'A'	16.638	0,06
12.400	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd 'A'	9.764	0,04
26.700	Shanxi Securities Co Ltd 'A**	24.684	0,09
3.300	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd 'A'	67.641	0,25
25.771	Shanxi Xishan Coal & Electricity Power Co Ltd 'A'	13.661	0,05
26.200	Shanying International Holding Co Ltd 'A'	10.926	0,04
15.300	Shenghe Resources Holding Co Ltd 'A'	15.248	0,06

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
10.004	Shengyi Technology Co Ltd 'A'	41.393	0,15
1.204	Shennan Circuits Co Ltd 'A'	28.512	0,10
67.100	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd 'A'	47.901	0,17
20.400	Shenzhen Energy Group Co Ltd 'A'	13.381	0,05
14.400	Shenzhen Fastprint Circuit Tech Co Ltd 'A'	26.117	0,09
1.400	Shenzhen Goodix Technology Co Ltd 'A'	44.113	0,16
6.600	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd 'A'	35.444	0,13
9.700	Shenzhen Jinjia Group Co Ltd 'A'	12.217	0,04
6.800	Shenzhen Kaifa Technology Co Ltd 'A'	20.984	0,08
2.800	Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd 'A'	64.185	0,23
6.400	Shenzhen Kingdom Sci-Tech Co Ltd 'A'	17.551	0,06
3.300	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd 'A'	142.606	0,52
37.126	Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd 'A'	31.804	0,12
2.100	Shenzhen SC New Energy Technology Corp 'A'	26.281	0,10
7.800	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd 'A'	27.510	0,10
10.300	Shenzhen Sunway Communication Co Ltd 'A'	77.198	0,28
34.143	Shenzhen Zhongjin Lingnan Nonfemet Co Ltd 'A'	17.955	0,07
5.600	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co Ltd 'A'	24.691	0,09
9.900	Siasun Robot & Automation Co Ltd 'A'	19.131	0,07
62.350	Sichuan Changhong Electric Co Ltd 'A'	25.296	0,09
8.124	Sichuan Chuantou Energy Co Ltd 'A'	10.646	0,04
78.500	Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd 'A'	14.648	0,05
12.804	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd 'A'	38.010	0,14
15.900	Sichuan Languang Development Co Ltd 'A'	12.115	0,04
20.532	Sichuan Road & Bridge Co Ltd 'A'	11.087	0,04
3.500	Sichuan Swellfun Co Ltd 'A'	30.883	0,11
19.630	Sinochem International Corp 'A'	14.041	0,05
16.985	Sinolink Securities Co Ltd 'A'	27.396	0,10

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
12.400	Sinoma International Engineering Co 'A'	9.255	0,03
16.560	Songcheng Performance Development Co Ltd 'A'	40.498	0,15
17.323	SooChow Securities Co Ltd 'A'	19.982	0,07
34.900	Southwest Securities Co Ltd 'A'	22.645	0,08
3.000	Spring Airlines Co Ltd 'A'	14.945	0,05
16.400	Sungrow Power Supply Co Ltd 'A'	33.361	0,12
7.900	Suning Universal Co Ltd 'A'	3.451	0,01
35.215	Suning.com Co Ltd 'A'	43.657	0,16
13.900	Sunwoda Electronic Co Ltd 'A'	37.137	0,13
8.600	Suofeiya Home Collection Co Ltd 'A'	29.384	0,11
9.600	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd 'A'	40.644	0,15
16.588	Suzhou Gold Mantis Construction Decoration Co Ltd 'A'	18.431	0,07
10.500	Tangshan Jidong Cement Co Ltd 'A'	23.808	0,09
50.500	TangShan Port Group Co Ltd 'A'	15.919	0,06
4.425	Tasly Pharmaceutical Group Co Ltd 'A'	10.146	0,04
33.438	TBEA Co Ltd 'A'	32.001	0,12
104.937	TCL Technology Group Corp 'A'	91.971	0,33
9.500	Tech-Bank Food Co Ltd 'A'	17.257	0,06
2.500	Thunder Software Technology Co Ltd 'A'	27.459	0,10
39.700	Tianfeng Securities Co Ltd 'A'	34.009	0,12
18.100	Tianjin Chase Sun Pharmaceutical Co Ltd 'A'	14.124	0,05
25.413	Tianjin Port Co Ltd 'A'	15.878	0,06
20.100	Tianjin Zhonghuan Semiconductor Co Ltd 'A'	63.817	0,23
10.800	Tianma Microelectronics Co Ltd 'A'	23.450	0,09
10.660	Tianqi Lithium Corp 'A'	34.584	0,13
39.389	Tianshui Huatian Technology Co Ltd 'A'	75.336	0,27
6.400	TongFu Microelectronics Co Ltd 'A'	22.663	0,08
14.600	Tonghua Dongbao Pharmaceutical Co Ltd 'A'	35.973	0,13



## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
9.980	Tongkun Group Co Ltd 'A'	18.002	0,07
115.200	Tongling Nonferrous Metals Group Co Ltd 'A'	31.430	0,11
14.700	Tongwei Co Ltd 'A'	36.116	0,13
3.200	Topchoice Medical Corp 'A'	75.439	0,27
24.450	Tsinghua Tongfang Co Ltd 'A'	25.196	0,09
2.900	Tsingtao Brewery Co Ltd 'A'	31.361	0,11
39.700	Tunghsu Optoelectronic Technology Co Ltd 'A'	14.984	0,05
8.501	Tus Environmental Science And Technology Development Co Ltd 'A'	8.917	0,03
5.000	Unigroup Guoxin Microelectronics Co Ltd 'A'	51.420	0,19
4.704	Unisplendour Corp Ltd 'A'	28.580	0,10
4.400	Universal Scientific Industrial Shanghai Co Ltd 'A'	13.584	0,05
5.000	Venustech Group Inc 'A'	29.735	0,11
11.600	Visionox Technology Inc 'A'	23.416	0,09
4.800	Visual China Group Co Ltd 'A'	12.634	0,05
12.600	Walvax Biotechnology Co Ltd 'A'	93.261	0,34
12.100	Wanda Film Holding Co Ltd 'A'	26.119	0,09
19.400	Wangsu Science & Technology Co Ltd 'A'	23.283	0,08
16.300	Wanhua Chemical Group Co Ltd 'A'	115.186	0,42
29.114	Wanxiang Qianchao Co Ltd 'A'	19.919	0,07
43.100	Weichai Power Co Ltd 'A'	83.591	0,30
2.700	Weihai Guangwei Composites Co Ltd 'A'	23.942	0,09
53.020	Wens Foodstuffs Group Co Ltd 'A'	163.390	0,59
14.332	Western Mining Co Ltd 'A'	11.751	0,04
12.834	Western Securities Co Ltd 'A'	14.804	0,05
6.240	Westone Information Industry Inc 'A'	18.824	0,07
1.700	Will Semiconductor Ltd 'A'	48.531	0,18
2.800	Wingtech Technology Co Ltd 'A'	49.852	0,18
15.990	Winning Health Technology Group Co Ltd 'A'	51.853	0,19

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
11.700	Wonders Information Co Ltd 'A'	36.502	0,13
30.875	Wuchan Zhongda Group Co Ltd 'A'	18.375	0,07
5.780	Wuhan Guide Infrared Co Ltd 'A'	23.924	0,09
12.600	Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd 'A'	83.358	0,30
18.700	Wuhu Token Science Co Ltd 'A'	29.607	0,11
19.425	Wuliangye Yibin Co Ltd 'A'	469.884	1,71
11.700	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd 'A'	41.315	0,15
8.880	WuXi AppTec Co Ltd 'A'	121.260	0,44
5.500	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd 'A'	35.928	0,13
22.900	Wuxi Rural Commercial Bank Co Ltd 'A'	15.894	0,06
13.800	Wuxi Taiji Industry Co Ltd 'A'	23.058	0,08
44.520	XCMG Construction Machinery Co Ltd 'A'	37.194	0,14
24.057	Xiamen C & D Inc 'A'	27.546	0,10
18.800	Xiamen ITG Group Corp Ltd 'A'	17.540	0,06
5.600	Xiamen Meiya Pico Information Co Ltd 'A'	15.698	0,06
67.328	Xinhu Zhongbao Co Ltd 'A'	28.362	0,10
15.818	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'A'	22.293	0,08
17.700	Xinjiang Zhongtai Chemical Co Ltd 'A'	11.334	0,04
36.769	Xinxing Ductile Iron Pipes Co Ltd 'A'	17.828	0,06
9.300	Xinyangfeng Agricultural Technology Co Ltd 'A'	11.622	0,04
38.400	Xinyu Iron & Steel Co Ltd 'A'	22.147	0,08
7.299	Xuji Electric Co Ltd 'A'	13.620	0,05
28.995	Yang Quan Coal Industry Group Co Ltd 'A'	17.297	0,06
21.800	Yango Group Co Ltd 'A'	19.538	0,07
5.660	Yantai Jereh Oilfield Services Group Co Ltd 'A'	24.803	0,09
2.550	Yealink Network Technology Corp Ltd 'A'	24.606	0,09
7.700	Yifan Pharmaceutical Co Ltd 'A'	25.002	0,09
2.300	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd 'A'	29.587	0,11

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
6.660	Yintai Gold Co Ltd 'A'	14.762	0,05
47.894	Yonghui Superstores Co Ltd 'A'	63.506	0,23
15.470	Yonyou Network Technology Co Ltd 'A'	96.440	0,35
26.020	Youngor Group Co Ltd 'A'	21.922	0,08
8.800	Youzu Interactive Co Ltd 'A'	32.443	0,12
8.190	Yuan Longping High-tech Agriculture Co Ltd 'A'	19.276	0,07
7.410	Yunda Holding Co Ltd 'A'	25.611	0,09
4.826	Yunnan Baiyao Group Co Ltd 'A'	63.998	0,23
45.000	Yunnan Chihong Zinc&Germanium Co Ltd 'A'	21.883	0,08
11.136	Yunnan Copper Co Ltd 'A'	16.702	0,06
3.800	Yunnan Energy New Material Co Ltd 'A'	35.346	0,13
9.896	Yunnan Tin Co Ltd 'A'	11.975	0,04
2.400	Zhangzhou Pientzehuag Pharmaceutical Co Ltd 'A'	57.760	0,21
39.000	Zhejiang China Commodities City Group Co Ltd 'A'	26.849	0,10
9.200	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd 'A'	34.269	0,12
21.200	Zhejiang Conba Pharmaceutical Co Ltd 'A'	16.483	0,06
13.800	Zhejiang Crystal-Optech Co Ltd 'A'	33.436	0,12
20.185	Zhejiang Dahua Technology Co Ltd 'A'	54.813	0,20
2.240	Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd 'A'	23.992	0,09
10.000	Zhejiang Hisun Pharmaceutical Co Ltd 'A'	20.285	0,07
7.480	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd 'A'	35.877	0,13
6.552	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd 'A'	35.992	0,13
13.800	Zhejiang Jiahua Energy Chemical Industry Co Ltd 'A'	17.050	0,06
7.100	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd 'A'	24.831	0,09
6.200	Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co Ltd 'A'	23.751	0,09
14.156	Zhejiang Juhua Co Ltd 'A'	13.788	0,05
22.700	Zhejiang Longsheng Group Co Ltd 'A'	41.042	0,15
2.468	Zhejiang Medicine Co Ltd 'A'	6.719	0,02

## L&amp;G E Fund MSCI China A UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 98,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>China (Fortsetzung)</b>			
10.515	Zhejiang NHU Co Ltd 'A'	43.255	0,16
12.137	Zhejiang Orient Financial Holdings Group Co Ltd 'A'	11.787	0,04
4.864	Zhejiang Runtu Co Ltd 'A'	6.284	0,02
15.912	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd 'A'	49.260	0,18
2.400	Zhejiang Supor Co Ltd 'A'	24.088	0,09
17.840	Zhejiang Wanfeng Auto Wheel Co Ltd 'A'	16.342	0,06
6.600	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd 'A'	10.851	0,04
2.600	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd 'A'	22.879	0,08
16.876	Zhengzhou Yutong Bus Co Ltd 'A'	29.104	0,11
9.600	Zheshang Securities Co Ltd 'A'	13.449	0,05
2.800	Zhongji Innolight Co Ltd 'A'	24.936	0,09
21.971	Zhongjin Gold Corp Ltd 'A'	28.387	0,10
110.736	Zijin Mining Group Co Ltd 'A'	68.876	0,25
42.986	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'A'	39.072	0,14
29.200	ZTE Corp 'A'	165.646	0,60
	<b>China insgesamt</b>	<b>27.067.996</b>	<b>98,37</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>27.083.962</b>	<b>98,43</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	27.083.962	98,43
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	433.049	1,57
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>27.517.011</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		98,36
	Sonstige Vermögenswerte		1,64
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

\* Der Handel dieses Wertpapiers wurde ausgesetzt.

## L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert €	% des Nettover-mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 91,07 %)</b>					
27.985.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,51) %	22.07.2020	27.985.328	92,20
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>27.985.328</b>	<b>92,20</b>
Nominal-betrag	Beschreibung			Nicht realisierter Gewinn €	% des Nettover-mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,68 %)</b>					
30.125.701	LevDAX® x2 Index <sup>1</sup>		20.07.2020	176.861	0,58
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>				<b>176.861</b>	<b>0,58</b>
Nominal-betrag	Beschreibung			Wert €	% des Nettover-mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: – %)</b>					
14.245	BlackRock Institutional Euro Cash Plus Fund			1.416.838	4,67
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>				<b>1.416.838</b>	<b>4,67</b>
<b>Gesamtanlagen</b>				Wert US\$	% des Nettover-mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				27.985.328	92,20
Geldmarktinstrumente				1.416.838	4,67
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten				176.861	0,58
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				775.263	2,55
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>30.354.290</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					% des Gesamt- vermö-gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					4,36
Einlagen bei Kreditinstituten					86,21
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente					0,54
Sonstige Vermögenswerte					8,89
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

## L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert €	% des Nettovermögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 96,59 %)</b>					
2.615.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,51) %	22.07.2020	2.615.000	3,86
6.585.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,51) %	22.07.2020	6.585.000	9,72
54.646.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,51) %	22.07.2020	54.646.403	80,63
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>63.846.403</b>	<b>94,21</b>

Nominalwert	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust €	% des Nettovermögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: (0,79 %))</b>			
68.643.388	ShortDAX® x2 Index <sup>1</sup>	(951.684)	(1,40)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten</b>			<b>(951.684) (1,40)</b>

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettovermögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: – %)</b>			
49.448	BlackRock Institutional Euro Cash Plus Fund	4.918.341	7,26
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>		<b>4.918.341</b>	<b>7,26</b>

Gesamtanlagen		Wert US\$	% des Nettovermögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		63.846.403	94,21
Geldmarktinstrumente		4.918.341	7,26
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten		(951.684)	(1,40)
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		(40.927)	(0,07)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>67.772.133</b>	<b>100,00</b>

Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden		7,15
Einlagen bei Kreditinstituten		92,84
Sonstige Vermögenswerte		0,01
		<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

## L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 93,42 %)</b>					
14.408.000	Barclays Bank Plc	0,31 %	22.07.2020	14.408.000	3,28
390.053.433	Barclays Bank Plc	0,31 %	22.07.2020	390.053.433	88,80
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>404.461.433</b>	<b>92,08</b>

Nominal- betrag	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettover- mögens	
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,62 %)</b>				
437.307.966	Dow Jones-UBS Commodity Index Total Return <sup>1</sup>	20.07.2020	1.951.562	0,44
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>			<b>1.951.562</b>	<b>0,44</b>

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 7,44 %)</b>			
25.761.829	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund	25.761.829	5,87
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>		<b>25.761.829</b>	<b>5,87</b>

Gesamtanlagen		Wert US\$	% des Nettover- mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		404.461.433	92,08
Geldmarktinstrumente		25.761.829	5,87
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten		1.951.562	0,44
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		7.068.722	1,61
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>439.243.546</b>	<b>100,00</b>

Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden		5,86
Einlagen bei Kreditinstituten		92,06
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente		0,44
Sonstige Vermögenswerte		1,64
		<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

## L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert £	% des Nettover-mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 92,88 %)</b>					
11.616.000	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2020	11.616.000	93,02
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>11.616.000</b>	<b>93,02</b>
Nominalwert	Beschreibung			Nicht realisierter Verlust £	% des Nettover-mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,17 %)</b>					
12.796.777	FTSE 100® Leveraged Index <sup>1</sup>	20.07.2020		(317.987)	(2,55)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten</b>				<b>(317.987)</b>	<b>(2,55)</b>
Nominal	Beschreibung			Wert £	% des Nettover-mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 7,04 %)</b>					
187.493	BlackRock Institutional Sterling Cash Plus Fund			187.493	1,50
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				<b>187.493</b>	<b>1,50</b>
<b>Gesamtanlagen</b>				Wert US\$	% des Nettover-mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				11.616.000	93,02
Geldmarktinstrumente				187.493	1,50
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten				(317.987)	(2,55)
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				1.002.203	8,03
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>12.487.709</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					% des Gesamt- vermö-gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					1,46
Einlagen bei Kreditinstituten					90,65
Sonstige Vermögenswerte					7,89
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.



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

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kupon-satz	Fälligkeits-termin	Wert £	% des Nettover-mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 92,85 %)</b>					
535.000	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2020	535.000	2,05
797.000	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2020	797.000	3,06
22.354.751	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2020	22.354.751	85,74
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>23.686.751</b>	<b>90,85</b>
Nominal-betrag	Beschreibung			Nicht realisierter Gewinn £	% des Nettover-mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: (0,18 %))</b>					
25.507.559	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index <sup>1</sup>	20.07.2020		526.945	2,02
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>				<b>526.945</b>	<b>2,02</b>
Nominal	Beschreibung			Wert £	% des Nettover-mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 6,82 %)</b>					
1.942.759	BlackRock Institutional Sterling Cash Plus Fund			1.942.759	7,45
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				<b>1.942.759</b>	<b>7,45</b>
<b>Gesamtanlagen</b>				Wert US\$	% des Nettover-mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				23.686.751	90,85
Geldmarktinstrumente				1.942.759	7,45
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten				526.945	2,02
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				(82.999)	(0,32)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>26.073.456</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					% des Gesamt- vermö-gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					7,43
Einlagen bei Kreditinstituten					90,56
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente					2,01
Sonstige Vermögenswerte					0,00
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

## L&amp;G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 92,72 %)</b>					
45.160.750	Merrill Lynch International	0,18 %	22.07.2020	45.160.750	92,44
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>45.160.750</b>	<b>92,44</b>
Nominalwert	Beschreibung			Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettover- mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,25 %)</b>					
48.573.881	Russell 2000® Index <sup>1</sup>		20.07.2020	284.054	0,58
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>				<b>284.054</b>	<b>0,58</b>
Nominal	Beschreibung			Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 4,33 %)</b>					
3.026.326	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund			3.026.326	6,19
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				<b>3.026.326</b>	<b>6,19</b>
<b>Gesamtanlagen</b>				Wert US\$	% des Nettover- mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				45.160.750	92,44
Geldmarktinstrumente				3.026.326	6,19
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten				284.054	0,58
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				385.475	0,79
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>48.856.605</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					6,19
Einlagen bei Kreditinstituten					92,40
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente					0,58
Sonstige Vermögenswerte					0,83
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Merrill Lynch International.

## L&amp;G Gold Mining UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kuponsatz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 92,78 %)</b>					
1.447.000	Merrill Lynch International	0,18 %	22.07.2020	1.447.000	0,53
5.558.000	Merrill Lynch International	0,18 %	22.07.2020	5.558.000	2,03
11.945.000	Merrill Lynch International	0,18 %	22.07.2020	11.945.000	4,36
223.148.799	Merrill Lynch International	0,18 %	22.07.2020	223.148.799	81,50
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>242.098.799</b>	<b>88,42</b>
Nominal-betrag	Beschreibung			Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettovermögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 3,24 %)</b>					
260.414.502	DAXglobal® Gold Miners (TR) USD Index <sup>1</sup>		20.07.2020	13.355.572	4,88
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>				<b>13.355.572</b>	<b>4,88</b>
Nominal	Beschreibung			Wert US\$	% des Nettovermögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 6,36 %)</b>					
24.932.004	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund			24.932.004	9,11
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				<b>24.932.004</b>	<b>9,11</b>
<b>Gesamtanlagen</b>				Wert US\$	% des Nettovermögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				242.098.799	88,42
Geldmarktinstrumente				24.932.004	9,11
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten				13.355.572	4,88
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				(6.585.734)	(2,41)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>273.800.641</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					% des Gesamtvermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					8,89
Einlagen bei Kreditinstituten					86,34
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente					4,76
Sonstige Vermögenswerte					0,01
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Merrill Lynch International.

## L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 87,75 %)</b>					
12.558.700	Citigroup Global Markets Limited	0,18 %	22.07.2020	12.558.700	92,49
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>12.558.700</b>	<b>92,49</b>
Nominal	Beschreibung			Nicht realisierter Verlust US\$	% des Nettover- mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: (1,00 %))</b>					
13.823.916	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR <sup>1</sup>		20.08.2020	(240.235)	(1,77)
<b>Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten</b>				<b>(240.235)</b>	<b>(1,77)</b>
Nominal	Beschreibung			Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 5,26 %)</b>					
428.239	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund			428.239	3,15
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				<b>428.239</b>	<b>3,15</b>
<b>Gesamtanlagen</b>				Wert US\$	% des Nettover- mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				12.558.700	92,49
Geldmarktinstrumente				428.239	3,15
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten				(240.235)	(1,77)
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				832.078	6,13
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>13.578.782</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					1,62
Einlagen bei Kreditinstituten					47,58
Sonstige Vermögenswerte					50,80
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Citigroup Global Markets Limited.

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,93 %)</b>			
<b>Belgien</b>			
349.084	Materialise NV ADR	7.875.335	0,96
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>7.875.335</b>	<b>0,96</b>
<b>Britische Jungferninseln</b>			
924.845	Hollysys Automation Technologies Ltd	12.300.439	1,51
<b>Britische Jungferninseln insgesamt</b>		<b>12.300.439</b>	<b>1,51</b>
<b>Kanada</b>			
620.284	ATS Automation Tooling Systems Inc	8.707.592	1,07
79.600	Novanta Inc	8.498.892	1,04
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>17.206.484</b>	<b>2,11</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
545.747	Airtac International Group	9.544.494	1,17
168.039	Ambarella Inc	7.696.186	0,94
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>17.240.680</b>	<b>2,11</b>
<b>China</b>			
485.421	Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A'	2.466.872	0,30
662.927	Iflytek Co Ltd	3.507.638	0,43
446.921	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	2.400.100	0,29
1.166.671	Siasun Robot & Automation Co Ltd	2.254.479	0,28
<b>China insgesamt</b>		<b>10.629.089</b>	<b>1,30</b>
<b>Finnland</b>			
357.859	Cargotec Oyj - Class B	8.304.013	1,02
<b>Finnland insgesamt</b>		<b>8.304.013</b>	<b>1,02</b>

## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich</b>			
51.975	Dassault Systemes SE	8.966.675	1,10
81.043	Schneider Electric SE	9.000.564	1,10
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>17.967.239</b>	<b>2,20</b>
<b>Deutschland</b>			
314.396	Duerr AG	8.192.392	1,00
267.643	GEA Group AG	8.462.136	1,04
337.556	Jenoptik AG	7.901.131	0,97
141.216	KION Group AG	8.691.810	1,06
177.395	Krones AG	11.376.881	1,39
73.457	Siemens AG	8.643.197	1,06
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>53.267.547</b>	<b>6,52</b>
<b>Israel</b>			
472.022	Stratasys Ltd	7.486.269	0,92
<b>Israel insgesamt</b>		<b>7.486.269</b>	<b>0,92</b>
<b>Japan</b>			
407.700	Amano Corp	8.453.677	1,04
160.397	Daifuku Co Ltd	14.005.096	1,72
275.206	Daihen Corp	9.808.288	1,20
70.720	FANUC Corp	12.625.177	1,55
531.688	Fuji Corp/Aichi	9.294.745	1,14
208.836	Harmonic Drive Systems Inc	11.440.152	1,40
31.144	Keyence Corp	12.999.160	1,59
682.728	Mitsubishi Electric Corp	8.856.448	1,08
287.056	Nabtesco Corp	8.833.721	1,08
189.488	Omron Corp	12.681.127	1,55
554.210	Optex Group Co Ltd	6.282.605	0,77

## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
346.541	Shibaura Machine Co Ltd	6.928.572	0,85
17.115	SMC Corp/Japan	8.753.819	1,07
328.349	THK Co Ltd	8.107.909	0,99
349.506	Yaskawa Electric Corp	12.067.571	1,48
582.280	Yokogawa Electric Corp	9.067.344	1,11
	<b>Japan insgesamt</b>	<b>160.205.411</b>	<b>19,62</b>
<b>Jersey</b>			
105.071	Aptiv Plc	8.187.132	1,00
	<b>Jersey insgesamt</b>	<b>8.187.132</b>	<b>1,00</b>
<b>Südkorea</b>			
137.064	Koh Young Technology Inc	11.394.937	1,40
	<b>Südkorea insgesamt</b>	<b>11.394.937</b>	<b>1,40</b>
<b>Schweden</b>			
894.664	Elekta AB	8.321.832	1,02
150.554	Hexagon AB	8.790.863	1,08
	<b>Schweden insgesamt</b>	<b>17.112.695</b>	<b>2,10</b>
<b>Schweiz</b>			
413.018	ABB Ltd	9.297.261	1,14
71.985	Kardex Holding AG	13.127.467	1,61
27.334	Tecan Group AG	9.681.002	1,19
	<b>Schweiz insgesamt</b>	<b>32.105.730</b>	<b>3,94</b>
<b>Taiwan</b>			
2.191.265	Adlink Technology Inc	6.142.035	0,75
912.593	Advantech Co Ltd	9.140.006	1,12

## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Taiwan (Fortsetzung)</b>			
1.751.790	Delta Electronics Inc	9.945.090	1,22
1.173.905	Global Unichip Corp	10.046.301	1,23
1.234.803	Hiwin Technologies Corp	12.283.373	1,50
	<b>Taiwan insgesamt</b>	<b>47.556.805</b>	<b>5,82</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
755.553	Blue Prism Group plc	10.614.592	1,30
333.886	Ocado Group Plc	8.366.505	1,02
172.887	Renishaw Plc	8.596.036	1,05
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>27.577.133</b>	<b>3,37</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>			
1.112.252	3D Systems Corp	7.774.641	0,95
168.362	AeroVironment Inc	13.406.666	1,64
38.596	Autodesk Inc	9.231.777	1,13
179.688	BioTelemetry Inc	8.120.101	0,99
294.250	Brooks Automation Inc	13.017.620	1,59
98.690	Cadence Design Systems Inc	9.470.292	1,16
221.956	Cognex Corp	13.255.212	1,62
54.104	Deere & Co	8.502.444	1,04
149.765	FARO Technologies Inc	8.027.404	0,98
277.075	FLIR Systems Inc	11.240.933	1,38
162.207	Globus Medical Inc	7.738.896	0,95
36.329	Illumina Inc	13.454.445	1,65
21.703	Intuitive Surgical Inc	12.367.020	1,51
75.910	IPG Photonics Corp	12.175.205	1,49
156.885	iRobot Corp	13.162.652	1,61
94.060	John Bean Technologies Corp	8.091.041	0,99
147.141	Manhattan Associates Inc	13.860.682	1,70



## L&amp;G ROBO Global® Robotics and Automation UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
82.002	Microchip Technology Inc	8.635.631	1,06
214.362	National Instruments Corp	8.297.953	1,02
44.958	Nordson Corp	8.528.982	1,04
399.661	Nuance Communications Inc	10.113.422	1,24
36.055	NVIDIA Corp	13.697.655	1,68
124.712	Omniceil Inc	8.807.161	1,08
107.718	PTC Inc	8.379.383	1,03
101.866	QUALCOMM Inc	9.291.198	1,14
377.105	Raven Industries Inc	8.111.529	0,99
56.574	Rockwell Automation Inc	12.050.262	1,48
32.947	ServiceNow Inc	13.345.512	1,63
23.926	Teledyne Technologies Inc	7.439.790	0,91
117.513	Teradyne Inc	9.931.024	1,22
199.919	Trimble Inc	8.634.502	1,06
68.145	Varian Medical Systems Inc	8.349.125	1,02
534.819	Vocera Communications Inc	11.338.163	1,39
93.767	Xilinx Inc	9.225.735	1,13
46.350	Zebra Technologies Corp	11.863.283	1,45
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>358.937.341</b>	<b>43,95</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>815.354.279</b>	<b>99,85</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	815.354.279	99,85
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.252.156	0,15
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>816.606.435</b>	<b>100,00</b>

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

Zum 30. Juni 2020

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	98,87
Sonstige Vermögenswerte	1,13
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

**L&G Cyber Security UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,35 %)</b>			
<b>Frankreich</b>			
284.352	Atos SE	24.240.624	1,57
229.850	Thales SA	18.556.596	1,20
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>42.797.220</b>	<b>2,77</b>
<b>Israel</b>			
287.101	Check Point Software Technologies Ltd	30.843.260	1,99
337.369	CyberArk Software Ltd	33.490.621	2,16
1.369.968	Radware Ltd	32.317.545	2,09
1.339.397	Tufin Software Technologies Ltd	12.791.241	0,83
<b>Israel insgesamt</b>		<b>109.442.667</b>	<b>7,07</b>
<b>Japan</b>			
583.557	Trend Micro Inc/Japan	32.562.574	2,10
<b>Japan insgesamt</b>		<b>32.562.574</b>	<b>2,10</b>
<b>Jersey</b>			
545.700	Mimecast Ltd	22.733.862	1,47
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>22.733.862</b>	<b>1,47</b>
<b>Südkorea</b>			
389.992	Ahnlab Inc	16.178.743	1,04
<b>Südkorea insgesamt</b>		<b>16.178.743</b>	<b>1,04</b>
<b>Schweden</b>			
19.103.177	Fingerprint Cards AB - Class B	34.662.597	2,24
<b>Schweden insgesamt</b>		<b>34.662.597</b>	<b>2,24</b>

## L&amp;G Cyber Security UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,35 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
5.917.479	Avast Plc '144A'	38.642.002	2,50
2.977.284	BAE Systems Plc	17.782.991	1,15
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>56.424.993</b>	<b>3,65</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>			
3.101.962	A10 Networks Inc	21.124.361	1,36
315.501	Akamai Technologies Inc	33.787.002	2,18
280.641	Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A	21.831.063	1,41
91.229	CACI International Inc - Class A	19.785.746	1,28
734.298	Cisco Systems Inc	34.247.659	2,21
1.229.355	Cloudflare Inc	44.195.312	2,86
518.412	CrowdStrike Holdings Inc	51.991.540	3,36
180.655	F5 Networks Inc	25.197.759	1,63
1.520.824	Fastly Inc	129.467.747	8,36
2.728.283	FireEye Inc	33.216.846	2,15
285.314	Fortinet Inc	39.165.053	2,53
145.590	General Dynamics Corp	21.759.881	1,41
1.508.111	Juniper Networks Inc	34.475.417	2,23
210.181	Leidos Holdings Inc	19.687.654	1,27
265.077	ManTech International Corp/VA - Class A	18.155.124	1,17
2.495.040	Mitek Systems Inc	23.977.334	1,55
5.069.260	MobileIron Inc	24.991.452	1,61
1.219.485	NetScout Systems Inc	31.170.037	2,01
63.670	Northrop Grumman Corp	19.574.705	1,26
1.542.770	NortonLifeLock Inc	30.593.129	1,98
157.558	Okta Inc	31.547.838	2,04
1.529.571	OneSpan Inc	42.720.918	2,76
176.049	Palo Alto Networks Inc	40.433.174	2,61
602.728	Parsons Corp	21.842.863	1,41

## L&G Cyber Security UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,35 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
972.046	Ping Identity Holding Corp	31.192.956	2,02
281.364	Proofpoint Inc	31.265.168	2,02
331.824	Qualys Inc	34.516.333	2,23
444.569	Rapid7 Inc	22.681.910	1,47
1.265.649	Sailpoint Technologies Holdings Inc	33.501.729	2,16
258.118	Science Applications International Corp	20.050.606	1,30
1.229.305	SolarWinds Corp	21.721.819	1,40
228.671	Splunk Inc	45.436.928	2,94
881.207	Tenable Holdings Inc	26.268.781	1,70
302.546	Varonis Systems Inc	26.769.270	1,73
447.981	Verint Systems Inc	20.239.782	1,31
238.358	VMware Inc	36.912.120	2,38
4.469.416	Zix Corp	30.838.970	1,99
316.516	Zscaler Inc	34.658.502	2,24
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>1.230.994.488</b>	<b>79,53</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>1.545.797.144</b>	<b>99,87</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	1.545.797.144	99,87
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.956.519	0,13
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>1.547.753.663</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		98,72
	Sonstige Vermögenswerte		1,28
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

## L&amp;G All Commodities UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 91,86 %)</b>					
45.918.070	Barclays Bank Plc	0,31 %	22.07.2020	45.918.070	91,00
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>45.918.070</b>	<b>91,00</b>
Nominal- betrag	Beschreibung			Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettover- mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 0,65 %)</b>					
50.357.959	Bloomberg Commodity Index Total Return <sup>1</sup>	20.07.2020		113.694	0,23
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>				<b>113.694</b>	<b>0,23</b>
Nominal	Beschreibung			Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 8,72 %)</b>					
3.554.208	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund			3.554.208	7,04
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				<b>3.554.208</b>	<b>7,04</b>
<b>Gesamtanlagen</b>				Wert US\$	% des Nettover- mögens
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				45.918.070	91,00
Geldmarktinstrumente				3.554.208	7,04
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten				113.694	0,23
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				874.498	1,73
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>50.460.470</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					% des Gesamt- vermö- gens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					7,04
Einlagen bei Kreditinstituten					90,98
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente					0,23
Sonstige Vermögenswerte					1,75
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW- Vorschriften vorgeschrieben.					

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

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

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Kupon- satz	Fälligkeits termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte (30. Juni 2019: 89,73 %)</b>					
7.224.553	Barclays Bank Plc	0,30 %	22.07.2020	7.224.553	92,60
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>				<b>7.224.553</b>	<b>92,60</b>
Nominal- betrag	Beschreibung			Nicht realisierter Gewinn US\$	% des Nettover- mögens
<b>Swap-Kontrakte (30. Juni 2019: 1,96 %)</b>					
7.765.615	Bloomberg ex-Agriculture and Livestock 15/30 Capped 3 Month Forward Total Return <sup>1</sup>		20.07.2020	33.305	0,43
<b>Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten</b>				<b>33.305</b>	<b>0,43</b>
Nominal	Beschreibung			Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Geldmarktinstrumente (30. Juni 2019: 8,33 %)</b>					
545.656	BlackRock Institutional US Dollar Cash Plus Fund			545.656	6,99
<b>Geldmarktinstrumente insgesamt</b>				<b>545.656</b>	<b>6,99</b>
<b>Gesamtanlagen</b>					
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				7.224.553	92,60
Geldmarktinstrumente				545.656	6,99
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten				33.305	0,43
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				(1.859)	(0,02)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>				<b>7.801.655</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht zur amtlichen Börsennotierung zugelassen sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden					6,99
Einlagen bei Kreditinstituten					92,58
Im Freiverkehr (OTC) gehandelte derivative Finanzinstrumente					0,43
Sonstige Vermögenswerte					0,00
					<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.					

<sup>1</sup> Der Kontrahent für die Swap-Kontrakte war Barclays Bank Plc.

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %)</b>			
<b>Australien</b>			
6.409.478	Galaxy Resources Ltd	3.420.068	3,07
280.886	Mineral Resources Ltd	4.094.127	3,68
23.292.982	Pilbara Minerals Ltd	4.009.364	3,60
	<b>Australien insgesamt</b>	<b>11.523.559</b>	<b>10,35</b>
<b>Bermuda</b>			
109.500	Brookfield Business Partners LP (Units)	3.359.744	3,02
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>3.359.744</b>	<b>3,02</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
3.315.811	Tianneng Power International Ltd	5.647.277	5,08
	<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>	<b>5.647.277</b>	<b>5,08</b>
<b>China</b>			
517.507	BYD Co Ltd 'H'	3.996.282	3,59
	<b>China insgesamt</b>	<b>3.996.282</b>	<b>3,59</b>
<b>Frankreich</b>			
163.899	Renault SA	4.156.734	3,74
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>4.156.734</b>	<b>3,74</b>
<b>Deutschland</b>			
55.863	Bayerische Motoren Werke AG	3.565.097	3,20
90.744	Daimler AG	3.683.935	3,31
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>7.249.032</b>	<b>6,51</b>



## L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan</b>			
217.234	GS Yuasa Corp	3.837.865	3,45
81.082	NEC Corp	3.885.564	3,49
241.892	NGK Insulators Ltd	3.336.288	3,00
956.216	Nissan Motor Co Ltd	3.538.226	3,18
415.730	Panasonic Corp	3.620.707	3,25
146.300	Showa Denko KK	3.276.275	2,95
306.344	Sumitomo Electric Industries Ltd	3.519.613	3,16
35.457	TDK Corp	3.510.042	3,16
123.045	Toshiba Corp	3.917.687	3,52
	<b>Japan insgesamt</b>	<b>32.442.267</b>	<b>29,16</b>
<b>Niederlande</b>			
215.169	AMG Advanced Metallurgical Group NV	3.840.161	3,45
	<b>Niederlande insgesamt</b>	<b>3.840.161</b>	<b>3,45</b>
<b>Südkorea</b>			
10.808	LG Chem Ltd	4.407.305	3,96
13.344	Samsung SDI Co Ltd	4.032.545	3,62
	<b>Südkorea insgesamt</b>	<b>8.439.850</b>	<b>7,58</b>
<b>Schweiz</b>			
170.286	ABB Ltd	3.833.232	3,45
	<b>Schweiz insgesamt</b>	<b>3.833.232</b>	<b>3,45</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
545.915	Aggreko Plc	2.986.902	2,68
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>2.986.902</b>	<b>2,68</b>

## L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten</b>			
52.165	EnerSys	3.358.383	3,02
496.523	General Electric Co	3.391.253	3,05
22.812	Honeywell International Inc	3.298.388	2,96
463.373	Livent Corp	2.854.378	2,57
8.253	Lockheed Martin Corp	3.011.685	2,71
26.396	SolarEdge Technologies Inc	3.663.238	3,29
3.812	Tesla Inc	4.116.237	3,70
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>23.693.562</b>	<b>21,30</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>111.168.602</b>	<b>99,91</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	111.168.602	99,91
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	95.843	0,09
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>111.264.445</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
	Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,42
	Sonstige Vermögenswerte		0,58
			<b>100,00</b>
	Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

## L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,92 %)</b>			
<b>Australien</b>			
3.047	CSL Ltd	602.094	2,35
458.634	Mesoblast Ltd	1.026.266	4,00
<b>Australien insgesamt</b>		<b>1.628.360</b>	<b>6,35</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
4.145	BeiGene Ltd ADR	780.918	3,04
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>780.918</b>	<b>3,04</b>
<b>Frankreich</b>			
9.953	Ipsen SA	845.685	3,30
6.605	Sanofi	672.491	2,62
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>1.518.176</b>	<b>5,92</b>
<b>Irland</b>			
138.145	Endo International Plc	473.837	1,85
18.115	Horizon Therapeutics Plc	1.006.832	3,93
5.308	Jazz Pharmaceuticals Plc	585.685	2,28
216.883	Mallinckrodt Plc	581.246	2,27
<b>Irland insgesamt</b>		<b>2.647.600</b>	<b>10,33</b>
<b>Japan</b>			
8.500	Eisai Co Ltd	673.319	2,63
26.100	Kyowa Kirin Co Ltd	684.404	2,67
17.650	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	656.037	2,56
8.913	Nippon Shinyaku Co Ltd	724.540	2,83
17.492	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	623.898	2,43
21.900	Torii Pharmaceutical Co Ltd	629.281	2,45
<b>Japan insgesamt</b>		<b>3.991.479</b>	<b>15,57</b>

## L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,92 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien</b>			
19.441	Grifols SA	590.215	2,30
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>590.215</b>	<b>2,30</b>
<b>Schweden</b>			
36.954	Swedish Orphan Biovitrum AB	853.580	3,33
<b>Schweden insgesamt</b>		<b>853.580</b>	<b>3,33</b>
<b>Schweiz</b>			
14.437	Basilea Pharmaceutica AG	741.690	2,89
7.518	Novartis AG	653.928	2,55
1.892	Roche Holding AG	655.622	2,56
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>2.051.240</b>	<b>8,00</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>			
7.154	AbbVie Inc	702.380	2,74
6.908	Alexion Pharmaceuticals Inc	775.354	3,02
1.999	Biogen Inc	534.832	2,09
6.741	BioMarin Pharmaceutical Inc	831.435	3,24
10.537	Bristol-Myers Squibb Co	619.576	2,42
10.835	Emergent BioSolutions Inc	856.832	3,34
32.605	Halozyne Therapeutics Inc	874.140	3,41
8.357	Incyte Corp	868.877	3,39
11.794	Ionis Pharmaceuticals Inc	695.374	2,71
32.241	Nektar Therapeutics - Class A	746.702	2,91
11.541	PTC Therapeutics Inc	585.590	2,28
5.427	Sarepta Therapeutics Inc	870.165	3,39

## L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,92 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
12.629	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	987.840	3,85
6.467	United Therapeutics Corp	782.507	3,05
2.721	Vertex Pharmaceuticals Inc	789.934	3,08
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>11.521.538</b>	<b>44,92</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>25.583.106</b>	<b>99,76</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		25.583.106	99,76
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		60.806	0,24
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>25.643.912</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			85,77
Sonstige Vermögenswerte			14,23
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

**L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,83 %)</b>			
<b>Belgien</b>			
195.699	bpost SA	1.318.820	2,24
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>1.318.820</b>	<b>2,24</b>
<b>Bermuda</b>			
1.034.064	Kerry Logistics Network Ltd	1.374.225	2,33
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>1.374.225</b>	<b>2,33</b>
<b>Kanada</b>			
36.927	Descartes Systems Group Inc/The	1.943.126	3,29
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>1.943.126</b>	<b>3,29</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
6.955	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.500.194	2,54
32.394	JD.com Inc ADR	1.949.471	3,30
88.168	Vipshop Holdings Ltd ADR	1.755.425	2,98
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>5.205.090</b>	<b>8,82</b>
<b>China</b>			
5.662.679	Sinotrans Ltd 'H'	1.147.083	1,94
<b>China insgesamt</b>		<b>1.147.083</b>	<b>1,94</b>
<b>Dänemark</b>			
1.434	AP Moller - Maersk A/S - Class B	1.669.993	2,83
14.814	DSV PANALPINA A/S	1.807.793	3,06
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>3.477.786</b>	<b>5,89</b>
<b>Frankreich</b>			
496.248	Bollere SA	1.558.410	2,64
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>1.558.410</b>	<b>2,64</b>

## L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,83 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland</b>			
48.639	Deutsche Post AG	1.778.203	3,01
11.350	SAP SE	1.584.830	2,69
31.284	Zalando SE '144A'	2.205.918	3,74
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>5.568.951</b>	<b>9,44</b>
<b>Japan</b>			
61.481	Hitachi Transport System Ltd	1.641.241	2,78
174.077	Japan Post Holdings Co Ltd	1.237.103	2,10
92.900	Kintetsu World Express Inc	1.604.233	2,72
28.957	Nippon Express Co Ltd	1.497.707	2,54
106.355	Nippon Yusen KK	1.494.501	2,53
165.800	Rakuten Inc	1.456.907	2,47
173.976	Senko Group Holdings Co Ltd	1.291.697	2,19
<b>Japan insgesamt</b>		<b>10.223.389</b>	<b>17,33</b>
<b>Neuseeland</b>			
63.270	Mainfreight Ltd	1.604.788	2,72
<b>Neuseeland insgesamt</b>		<b>1.604.788</b>	<b>2,72</b>
<b>Südkorea</b>			
12.338	CJ Logistics Corp	1.615.526	2,74
<b>Südkorea insgesamt</b>		<b>1.615.526</b>	<b>2,74</b>
<b>Spanien</b>			
81.498	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	1.519.500	2,58
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>1.519.500</b>	<b>2,58</b>

## L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,83 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz</b>			
9.476	Kuehne + Nagel International AG	1.574.073	2,67
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>1.574.073</b>	<b>2,67</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
80.069	Ocado Group Plc	2.006.366	3,40
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>2.006.366</b>	<b>3,40</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>			
669	Amazon.com Inc	1.845.651	3,13
40.370	eBay Inc	2.117.407	3,59
19.106	Expeditors International of Washington Inc	1.452.820	2,46
11.168	FedEx Corp	1.565.977	2,65
23.649	Manhattan Associates Inc	2.227.736	3,78
25.682	Oracle Corp	1.419.444	2,41
43.648	Ryder System Inc	1.637.236	2,78
15.992	SYNNEX Corp	1.915.362	3,25
13.839	United Parcel Service Inc - Class B	1.538.620	2,61
11.213	Walmart Inc	1.343.093	2,28
22.064	XPO Logistics Inc	1.704.444	2,89
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>18.767.790</b>	<b>31,83</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>58.904.923</b>	<b>99,86</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		58.904.923	99,86
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		82.878	0,14
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>58.987.801</b>	<b>100,00</b>



**L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2020

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		98,34
Sonstige Vermögenswerte		1,66
		<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %)</b>			
<b>Bermuda</b>			
2.099	Arch Capital Group Ltd	60.136	0,04
1.061	Athene Holding Ltd - Class A	33.093	0,02
230	Everest Re Group Ltd	47.426	0,03
1.955	IHS Markit Ltd	147.602	0,11
3.516	Marvell Technology Group Ltd	123.271	0,09
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>411.528</b>	<b>0,29</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
355	Sea Ltd ADR	38.070	0,03
	<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>	<b>38.070</b>	<b>0,03</b>
<b>Curacao</b>			
7.480	Schlumberger Ltd	137.557	0,10
	<b>Curacao insgesamt</b>	<b>137.557</b>	<b>0,10</b>
<b>Guernsey</b>			
699	Amdocs Ltd	42.555	0,03
	<b>Guernsey insgesamt</b>	<b>42.555</b>	<b>0,03</b>
<b>Irland</b>			
3.402	Accenture Plc - Class A	730.477	0,53
1.229	Aon Plc	236.705	0,17
2.222	Eaton Corp Plc	194.381	0,14
281	Jazz Pharmaceuticals Plc	31.006	0,02
4.141	Johnson Controls International plc	141.374	0,10
2.843	Linde Plc	603.029	0,44
7.143	Medtronic Plc	655.013	0,48
730	Perrigo Co Plc	40.347	0,03
1.210	Seagate Technology Plc	58.576	0,04

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettöver- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland (Fortsetzung)</b>			
1.279	Trane Technologies Plc	113.805	0,08
676	Willis Towers Watson Plc	133.138	0,10
<b>Irland insgesamt</b>		<b>2.937.851</b>	<b>2,13</b>
<b>Jersey</b>			
8.663	Amcor Plc	88.449	0,06
1.307	Aptiv Plc	101.841	0,07
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>190.290</b>	<b>0,13</b>
<b>Liberia</b>			
934	Royal Caribbean Cruises Ltd	46.980	0,03
<b>Liberia insgesamt</b>		<b>46.980</b>	<b>0,03</b>
<b>Luxemburg</b>			
665	Spotify Technology SA	171.696	0,13
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>171.696</b>	<b>0,13</b>
<b>Niederlande</b>			
1.362	LyondellBasell Industries NV	89.511	0,07
2.689	Mylan NV	43.239	0,03
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>132.750</b>	<b>0,10</b>
<b>Panama</b>			
2.548	Carnival Corp	41.838	0,03
<b>Panama insgesamt</b>		<b>41.838</b>	<b>0,03</b>

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz</b>			
2.064	Chubb Ltd	261.344	0,19
742	Garmin Ltd	72.345	0,05
3.368	TE Connectivity Ltd	274.660	0,20
	<b>Schweiz insgesamt</b>	<b>608.349</b>	<b>0,44</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
636	Atlassian Corp Plc	114.652	0,08
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>114.652</b>	<b>0,08</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>			
3.050	3M Co	475.770	0,35
691	A O Smith Corp	32.560	0,02
9.371	Abbott Laboratories	856.791	0,62
9.347	AbbVie Inc	917.688	0,67
226	ABIOMED Inc	54.593	0,04
4.025	Activision Blizzard Inc	305.498	0,22
2.556	Adobe Inc	1.112.652	0,81
349	Advance Auto Parts Inc	49.715	0,04
6.240	Advanced Micro Devices Inc	328.286	0,24
3.651	Aflac Inc	131.546	0,10
1.646	Agilent Technologies Inc	145.457	0,11
1.168	Air Products & Chemicals Inc	282.025	0,21
847	Akamai Technologies Inc	90.705	0,07
578	Albemarle Corp	44.627	0,03
668	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	108.383	0,08
1.117	Alexion Pharmaceuticals Inc	125.372	0,09
383	Align Technology Inc	105.111	0,08
71	Alleghany Corp	34.729	0,03

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
1.296	Alliant Energy Corp	62.001	0,05
1.659	Allstate Corp/The	160.906	0,12
1.904	Ally Financial Inc	37.756	0,03
1.714	Alphabet Inc	2.422.928	1,76
1.451	Alphabet Inc - Class A	2.057.591	1,50
1.760	Altice USA Inc	39.670	0,03
9.909	Altria Group Inc	388.928	0,28
2.253	Amazon.com Inc	6.215.621	4,53
1.261	Ameren Corp	88.724	0,06
2.630	American Electric Power Co Inc	209.453	0,15
3.249	American Express Co	309.305	0,23
399	American Financial Group Inc/OH	25.321	0,02
4.610	American International Group Inc	143.740	0,10
2.365	American Tower Corp (REIT)	611.447	0,45
954	American Water Works Co Inc	122.742	0,09
660	Ameriprise Financial Inc	99.026	0,07
799	AmerisourceBergen Corp - Class A	80.515	0,06
1.202	AMETEK Inc	107.423	0,08
3.125	Amgen Inc	737.063	0,54
1.589	Amphenol Corp - Class A	152.242	0,11
1.950	Analog Devices Inc	239.148	0,17
7.875	Annaly Capital Management Inc (REIT)	51.660	0,04
446	ANSYS Inc	130.112	0,09
1.354	Anthem Inc	356.075	0,26
1.114	Apollo Global Management Inc - Class A	55.611	0,04
23.555	Apple Inc	8.592.864	6,26
4.886	Applied Materials Inc	295.359	0,22
2.953	Archer-Daniels-Midland Co	117.825	0,09

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
294	Arista Networks Inc	61.749	0,05
981	Arthur J Gallagher & Co	95.638	0,07
38.241	AT&T Inc	1.156.025	0,84
685	Atmos Energy Corp	68.212	0,05
1.163	Autodesk Inc	278.178	0,20
2.135	Automatic Data Processing Inc	317.880	0,23
123	AutoZone Inc	138.759	0,10
740	AvalonBay Communities Inc (REIT)	114.434	0,08
310	Avangrid Inc	13.014	0,01
3.439	Baker Hughes Co - Class A	52.926	0,04
1.719	Ball Corp	119.453	0,09
41.725	Bank of America Corp	990.969	0,72
4.223	Bank of New York Mellon Corp/The	163.219	0,12
2.687	Baxter International Inc	231.351	0,17
1.438	Becton Dickinson and Co	344.070	0,25
7.070	Berkshire Hathaway Inc - Class B	1.262.066	0,92
1.224	Best Buy Co Inc	106.818	0,08
920	Biogen Inc	246.146	0,18
928	BioMarin Pharmaceutical Inc	114.460	0,08
593	BlackRock Inc	322.645	0,24
3.630	Blackstone Group Inc/The	205.676	0,15
2.846	Boeing Co/The	521.672	0,38
219	Booking Holdings Inc	348.722	0,25
767	Boston Properties Inc (REIT)	69.321	0,05
7.482	Boston Scientific Corp	262.693	0,19
12.073	Bristol-Myers Squibb Co	709.892	0,52
2.084	Broadcom Inc	657.731	0,48
606	Broadridge Financial Solutions Inc	76.471	0,06

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
2.023	Brown-Forman Corp	116.464	0,08
2.035	Cabot Oil & Gas Corp	34.961	0,03
1.449	Cadence Design Systems Inc	139.046	0,10
1.007	Campbell Soup Co	49.977	0,04
2.397	Capital One Financial Corp	150.028	0,11
1.563	Cardinal Health Inc	81.573	0,06
873	CarMax Inc	78.177	0,06
2.957	Caterpillar Inc	374.061	0,27
548	Cboe Global Markets Inc	51.117	0,04
1.721	CBRE Group Inc - Class A	77.824	0,06
757	CDW Corp/DE	87.948	0,06
620	Celanese Corp - Class A	53.531	0,04
3.084	Centene Corp	195.988	0,14
2.711	CenterPoint Energy Inc	50.614	0,04
5.724	CenturyLink Inc	57.412	0,04
1.566	Cerner Corp	107.349	0,08
654	CH Robinson Worldwide Inc	51.705	0,04
6.177	Charles Schwab Corp/The	208.412	0,15
908	Charter Communications Inc	463.116	0,34
1.240	Cheniere Energy Inc	59.917	0,04
9.961	Chevron Corp	888.820	0,65
316	Chewy Inc	14.122	0,01
146	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	153.645	0,11
1.291	Church & Dwight Co Inc	99.794	0,07
2.009	Cigna Corp	376.989	0,27
858	Cincinnati Financial Corp	54.938	0,04
472	Cintas Corp	125.722	0,09
20.942	Cisco Systems Inc	976.735	0,71

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
11.177	Citigroup Inc	571.145	0,42
2.235	Citizens Financial Group Inc	56.411	0,04
604	Citrix Systems Inc	89.338	0,07
651	Clorox Co/The	142.810	0,10
1.873	CME Group Inc	304.437	0,22
1.465	CMS Energy Corp	85.585	0,06
20.649	Coca-Cola Co/The	922.597	0,67
2.956	Cognizant Technology Solutions Corp	167.960	0,12
4.489	Colgate-Palmolive Co	328.864	0,24
24.093	Comcast Corp	939.145	0,68
2.552	Conagra Brands Inc	89.754	0,07
1.028	Concho Resources Inc	52.942	0,04
5.707	ConocoPhillips	239.808	0,17
1.767	Consolidated Edison Inc	127.100	0,09
838	Constellation Brands Inc - Class A	146.608	0,11
274	Cooper Cos Inc/The	77.717	0,06
1.117	Copart Inc	93.013	0,07
4.035	Corning Inc	104.506	0,08
3.959	Corteva Inc	106.062	0,08
194	CoStar Group Inc	137.870	0,10
2.311	Costco Wholesale Corp	700.718	0,51
2.226	Crown Castle International Corp (REIT)	372.521	0,27
4.071	CSX Corp	283.912	0,21
790	Cummins Inc	136.875	0,10
6.985	CVS Health Corp	453.815	0,33
3.295	Danaher Corp	582.655	0,42
639	Darden Restaurants Inc	48.417	0,04
454	DaVita Inc	35.930	0,03



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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
1.658	Deere & Co	260.555	0,19
1.281	Dell Technologies Inc	70.378	0,05
3.064	Delta Air Lines Inc	85.945	0,06
1.125	DENTSPLY SIRONA Inc	49.568	0,04
483	DexCom Inc	195.808	0,14
1.385	Digital Realty Trust Inc (REIT)	196.822	0,14
1.561	Discover Financial Services	78.190	0,06
2.679	Discovery Inc	51.598	0,04
1.310	DISH Network Corp - Class A	45.208	0,03
873	DocuSign Inc - Class A	150.339	0,11
1.337	Dollar General Corp	254.712	0,19
1.210	Dollar Tree Inc	112.143	0,08
4.478	Dominion Energy Inc	363.524	0,26
205	Domino's Pizza Inc	75.735	0,06
781	Dover Corp	75.413	0,06
3.958	Dow Inc	161.328	0,12
1.860	DR Horton Inc	103.137	0,08
1.341	Dropbox Inc	29.194	0,02
1.023	DTE Energy Co	109.973	0,08
3.934	Duke Energy Corp	314.287	0,23
1.954	Duke Realty Corp (REIT)	69.152	0,05
3.891	DuPont de Nemours Inc	206.729	0,15
1.189	E*TRADE Financial Corp	59.129	0,04
706	Eastman Chemical Co	49.166	0,04
4.072	eBay Inc	213.576	0,16
1.362	Ecolab Inc	270.970	0,20
1.966	Edison International	106.773	0,08
3.324	Edwards Lifesciences Corp	229.722	0,17

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
2.093	Elanco Animal Health Inc	44.895	0,03
1.494	Electronic Arts Inc	197.283	0,14
4.497	Eli Lilly and Co	738.317	0,54
3.269	Emerson Electric Co	202.776	0,15
1.061	Entergy Corp	99.532	0,07
3.084	EOG Resources Inc	156.235	0,11
639	Equifax Inc	109.831	0,08
456	Equinix Inc (REIT)	320.249	0,23
1.945	Equity Residential (REIT)	114.405	0,08
354	Essex Property Trust Inc (REIT)	81.126	0,06
1.032	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	194.718	0,14
1.208	Evergy Inc	71.622	0,05
1.769	Eversource Energy	147.305	0,11
5.186	Exelon Corp	188.200	0,14
714	Expedia Group Inc	58.691	0,04
806	Expeditors International of Washington Inc	61.288	0,04
664	Extra Space Storage Inc (REIT)	61.334	0,04
22.566	Exxon Mobil Corp	1.009.152	0,74
316	F5 Networks Inc	44.076	0,03
12.761	Facebook Inc - Class A	2.897.640	2,11
3.018	Fastenal Co	129.291	0,09
393	Federal Realty Investment Trust (REIT)	33.488	0,02
1.265	FedEx Corp	177.378	0,13
1.328	Fidelity National Financial Inc	40.716	0,03
3.275	Fidelity National Information Services Inc	439.145	0,32
3.636	Fifth Third Bancorp	70.102	0,05
897	First Republic Bank/CA	95.073	0,07
2.893	FirstEnergy Corp	112.191	0,08

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
3.005	Fiserv Inc	293.348	0,21
456	FleetCor Technologies Inc	114.698	0,08
679	FMC Corp	67.642	0,05
19.833	Ford Motor Co	120.585	0,09
783	Fortinet Inc	107.482	0,08
1.551	Fortive Corp	104.941	0,08
781	Fortune Brands Home & Security Inc	49.929	0,04
585	Fox Corp	15.701	0,01
1.978	Fox Corp	53.050	0,04
1.500	Franklin Resources Inc	31.455	0,02
456	Gartner Inc	55.326	0,04
1.360	General Dynamics Corp	203.266	0,15
45.937	General Electric Co	313.750	0,23
3.204	General Mills Inc	197.527	0,14
6.570	General Motors Co	166.221	0,12
791	Genuine Parts Co	68.785	0,05
6.679	Gilead Sciences Inc	513.882	0,37
1.595	Global Payments Inc	270.544	0,20
539	Globe Life Inc	40.010	0,03
1.764	Goldman Sachs Group Inc/The	348.602	0,25
4.343	Halliburton Co	56.372	0,04
1.864	Hartford Financial Services Group Inc/The	71.857	0,05
681	Hasbro Inc	51.041	0,04
1.436	HCA Healthcare Inc	139.378	0,10
2.683	Healthpeak Properties Inc (REIT)	73.943	0,05
746	Henry Schein Inc	43.559	0,03
773	Hershey Co/The	100.196	0,07
1.457	Hess Corp	75.487	0,06

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
6.903	Hewlett Packard Enterprise Co	67.166	0,05
1.448	Hilton Worldwide Holdings Inc	106.356	0,08
1.391	Hologic Inc	79.287	0,06
5.725	Home Depot Inc/The	1.434.170	1,04
3.752	Honeywell International Inc	542.502	0,40
1.447	Hormel Foods Corp	69.847	0,05
3.759	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	40.560	0,03
7.585	HP Inc	132.207	0,10
706	Humana Inc	273.752	0,20
5.434	Huntington Bancshares Inc/OH	49.096	0,04
218	Huntington Ingalls Industries Inc	38.039	0,03
413	IAC/interactivecorp	133.564	0,10
448	IDEXX Laboratories Inc	147.912	0,11
1.517	Illinois Tool Works Inc	265.247	0,19
783	Illumina Inc	289.984	0,21
968	Incyte Corp	100.643	0,07
1.781	Ingersoll Rand Inc	50.082	0,04
22.888	Intel Corp	1.369.389	1,00
381	Interactive Brokers Group Inc	15.914	0,01
2.874	Intercontinental Exchange Inc	263.258	0,19
4.719	International Business Machines Corp	569.914	0,42
560	International Flavors & Fragrances Inc	68.578	0,05
2.165	International Paper Co	76.230	0,06
2.049	Interpublic Group of Cos Inc/The	35.161	0,03
1.332	Intuit Inc	394.525	0,29
612	Intuitive Surgical Inc	348.736	0,25
2.798	Invitation Homes Inc (REIT)	77.029	0,06
976	IQVIA Holdings Inc	138.475	0,10

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
1.506	Iron Mountain Inc (REIT)	39.307	0,03
595	J M Smucker Co/The	62.957	0,05
433	JB Hunt Transport Services Inc	52.107	0,04
15.834	JPMorgan Chase & Co	1.489.346	1,08
1.693	Juniper Networks Inc	38.702	0,03
501	Kansas City Southern	74.794	0,05
1.330	Kellogg Co	87.860	0,06
1.619	Keurig Dr Pepper Inc	45.980	0,03
4.953	KeyCorp	60.328	0,04
988	Keysight Technologies Inc	99.571	0,07
1.793	Kimberly-Clark Corp	253.441	0,18
10.339	Kinder Morgan Inc	156.843	0,11
2.870	KKR & Co Inc	88.626	0,06
835	KLA Corp	162.391	0,12
3.464	Kraft Heinz Co/The	110.467	0,08
3.986	Kroger Co/The	134.926	0,10
1.150	L3Harris Technologies Inc	195.121	0,14
518	Laboratory Corp of America Holdings	86.045	0,06
773	Lam Research Corp	250.035	0,18
1.967	Las Vegas Sands Corp	89.577	0,07
771	Leidos Holdings Inc	72.220	0,05
2.053	Lennar Corp	94.623	0,07
890	Liberty Broadband Corp	110.324	0,08
1.186	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	40.858	0,03
1.033	Lincoln National Corp	38.004	0,03
1.606	LKQ Corp	42.077	0,03
1.275	Lockheed Martin Corp	465.273	0,34
1.364	Loews Corp	46.772	0,03

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
4.028	Lowe's Cos Inc	544.263	0,40
636	Lululemon Athletica Inc	198.438	0,14
1.182	Lyft Inc	39.018	0,03
661	M&T Bank Corp	68.724	0,05
3.430	Marathon Petroleum Corp	128.213	0,09
72	Markel Corp	66.468	0,05
1.394	Marriott International Inc/MD	119.508	0,09
2.693	Marsh & McLennan Cos Inc	289.147	0,21
327	Martin Marietta Materials Inc	67.548	0,05
1.443	Masco Corp	72.453	0,05
4.696	Mastercard Inc	1.388.607	1,01
285	Match Group Inc	30.509	0,02
1.388	Maxim Integrated Products Inc	84.127	0,06
642	McCormick & Co Inc/MD	115.181	0,08
3.955	McDonald's Corp	729.579	0,53
857	McKesson Corp	131.481	0,10
253	MercadoLibre Inc	249.400	0,18
13.443	Merck & Co Inc	1.039.547	0,76
3.786	MetLife Inc	138.265	0,10
128	Mettler-Toledo International Inc	103.110	0,08
2.342	MGM Resorts International	39.346	0,03
1.241	Microchip Technology Inc	130.690	0,10
5.903	Micron Technology Inc	304.123	0,22
40.450	Microsoft Corp	8.231.980	6,00
596	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	68.343	0,05
313	Mohawk Industries Inc	31.851	0,02
972	Molson Coors Beverage Co - Class B	33.398	0,02
7.503	Mondelez International Inc	383.628	0,28

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
2.056	Monster Beverage Corp	142.522	0,10
874	Moody's Corp	240.114	0,17
6.408	Morgan Stanley	309.506	0,23
900	Motorola Solutions Inc	126.117	0,09
439	MSCI Inc - Class A	146.547	0,11
608	Nasdaq Inc	72.638	0,05
1.214	NetApp Inc	53.865	0,04
2.294	Netflix Inc	1.043.862	0,76
2.257	Newell Brands Inc	35.841	0,03
4.302	Newmont Corp	265.605	0,19
2.622	NextEra Energy Inc	629.726	0,46
6.559	NIKE Inc	643.110	0,47
1.961	NiSource Inc	44.593	0,03
1.360	Norfolk Southern Corp	238.775	0,17
1.039	Northern Trust Corp	82.434	0,06
798	Northrop Grumman Corp	245.337	0,18
2.902	NortonLifeLock Inc	57.547	0,04
1.586	Nucor Corp	65.676	0,05
3.144	NVIDIA Corp	1.194.437	0,87
19	NVR Inc	61.916	0,05
4.650	Occidental Petroleum Corp	85.095	0,06
610	Okta Inc	122.140	0,09
578	Old Dominion Freight Line Inc	98.023	0,07
1.092	Omnicom Group Inc	59.623	0,04
2.219	ONEOK Inc	73.715	0,05
10.686	Oracle Corp	590.615	0,43
389	O'Reilly Automotive Inc	164.030	0,12
1.830	PACCAR Inc	136.975	0,10

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
517	Packaging Corp of America	51.597	0,04
513	Palo Alto Networks Inc	117.821	0,09
694	Parker-Hannifin Corp	127.189	0,09
1.696	Paychex Inc	128.472	0,09
6.270	PayPal Holdings Inc	1.092.422	0,80
7.405	PepsiCo Inc	979.385	0,71
29.371	Pfizer Inc	960.432	0,70
8.263	Philip Morris International Inc	578.906	0,42
2.314	Phillips 66	166.377	0,12
578	Pinnacle West Capital Corp	42.362	0,03
847	Pioneer Natural Resources Co	82.752	0,06
2.083	PNC Financial Services Group Inc/The	219.152	0,16
1.244	PPG Industries Inc	131.939	0,10
4.120	PPL Corp	106.461	0,08
1.496	Principal Financial Group Inc	62.144	0,05
13.009	Procter & Gamble Co/The	1.555.486	1,13
3.128	Progressive Corp/The	250.584	0,18
3.953	Prologis Inc (REIT)	368.933	0,27
2.135	Prudential Financial Inc	130.021	0,09
2.681	Public Service Enterprise Group Inc	131.798	0,10
790	Public Storage (REIT)	151.593	0,11
1.459	PulteGroup Inc	49.650	0,04
587	Qorvo Inc	64.881	0,05
6.106	QUALCOMM Inc	556.928	0,41
694	Quest Diagnostics Inc	79.088	0,06
681	Raymond James Financial Inc	46.873	0,03
8.138	Raytheon Technologies Corp	501.464	0,37
1.817	Realty Income Corp (REIT)	108.112	0,08



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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
828	Regency Centers Corp (REIT)	37.997	0,03
437	Regeneron Pharmaceuticals Inc	272.535	0,20
5.035	Regions Financial Corp	55.989	0,04
353	Reinsurance Group of America Inc	27.689	0,02
1.078	Republic Services Inc - Class A	88.450	0,06
765	ResMed Inc	146.880	0,11
398	RingCentral Inc - Class A	113.434	0,08
616	Rockwell Automation Inc	131.208	0,10
799	Rollins Inc	33.870	0,02
547	Roper Technologies Inc	212.378	0,15
1.858	Ross Stores Inc	158.376	0,12
1.287	S&P Global Inc	424.041	0,31
4.587	salesforce.com Inc	859.283	0,63
596	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	177.560	0,13
642	Seattle Genetics Inc	109.089	0,08
723	SEI Investments Co	39.751	0,03
1.568	Sempra Energy	183.817	0,13
1.006	ServiceNow Inc	407.490	0,30
441	Sherwin-Williams Co/The	254.832	0,19
1.652	Simon Property Group Inc (REIT)	112.964	0,08
5.509	Sirius XM Holdings Inc	32.338	0,02
900	Skyworks Solutions Inc	115.074	0,08
5.332	Snap Inc	125.249	0,09
288	Snap-on Inc	39.891	0,03
5.683	Southern Co/The (Units)	294.664	0,21
2.340	Southwest Airlines Co	79.981	0,06
841	Splunk Inc	167.107	0,12
1.893	Square Inc	198.651	0,14

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
1.181	SS&C Technologies Holdings Inc	66.703	0,05
831	Stanley Black & Decker Inc	115.825	0,08
6.220	Starbucks Corp	457.730	0,33
1.766	State Street Corp	112.229	0,08
1.737	Stryker Corp	312.990	0,23
278	SVB Financial Group	59.917	0,04
2.864	Synchrony Financial	63.466	0,05
780	Synopsys Inc	152.100	0,11
2.563	Sysco Corp	140.094	0,10
1.221	T Rowe Price Group Inc	150.794	0,11
572	Take-Two Interactive Software Inc	79.834	0,06
2.654	Target Corp	318.294	0,23
1.371	TD Ameritrade Holding Corp	49.877	0,04
240	Teleflex Inc	87.355	0,06
782	Tesla Inc	844.411	0,62
4.968	Texas Instruments Inc	630.787	0,46
1.197	Textron Inc	39.393	0,03
2.113	Thermo Fisher Scientific Inc	765.624	0,56
631	Tiffany & Co	76.944	0,06
5.880	TJX Cos Inc/The	297.293	0,22
2.021	T-Mobile US Inc	210.487	0,15
612	Tractor Supply Co	80.655	0,06
272	TransDigm Group Inc	120.238	0,09
1.014	TransUnion	88.259	0,06
1.306	Travelers Cos Inc/The	148.949	0,11
1.365	Trimble Inc	58.954	0,04
7.144	Truist Financial Corp	268.257	0,20
661	Twilio Inc - Class A	145.037	0,11

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
3.970	Twitter Inc	118.266	0,09
1.548	Tyson Foods Inc - Class A	92.431	0,07
5.880	Uber Technologies Inc	182.750	0,13
1.542	UDR Inc (REIT)	57.640	0,04
1.106	UGI Corp	35.171	0,03
284	Ulta Beauty Inc	57.771	0,04
3.610	Union Pacific Corp	610.343	0,44
1.136	United Airlines Holdings Inc	39.317	0,03
3.722	United Parcel Service Inc - Class B	413.812	0,30
402	United Rentals Inc	59.914	0,04
5.041	UnitedHealth Group Inc	1.486.843	1,08
402	Universal Health Services Inc	37.342	0,03
7.400	US Bancorp	272.468	0,20
209	Vail Resorts Inc	38.069	0,03
2.164	Valero Energy Corp	127.286	0,09
472	Varian Medical Systems Inc	57.829	0,04
710	Veeva Systems Inc - Class A	166.438	0,12
1.959	Ventas Inc (REIT)	71.739	0,05
541	VeriSign Inc	111.895	0,08
854	Verisk Analytics Inc - Class A	145.351	0,11
21.987	Verizon Communications Inc	1.212.143	0,88
1.374	Vertex Pharmaceuticals Inc	398.886	0,29
1.761	VF Corp	107.315	0,08
2.841	ViacomCBS Inc	72.730	0,05
9.070	Visa Inc - Class A	1.752.052	1,28
417	VMware Inc	64.577	0,05
945	Vornado Realty Trust (REIT)	36.108	0,03
703	Vulcan Materials Co	81.443	0,06

## L&amp;G US Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
759	W R Berkley Corp	43.483	0,03
3.854	Walgreens Boots Alliance Inc	163.371	0,12
7.370	Walmart Inc	882.779	0,64
9.629	Walt Disney Co/The	1.073.730	0,78
2.239	Waste Management Inc	237.132	0,17
319	Waters Corp	57.548	0,04
1.690	WEC Energy Group Inc	148.129	0,11
2.200	Welltower Inc (REIT)	113.850	0,08
1.539	Western Digital Corp	67.947	0,05
2.205	Western Union Co/The	47.672	0,03
968	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	55.728	0,04
1.434	Westrock Co	40.525	0,03
3.991	Weyerhaeuser Co (REIT)	89.638	0,07
333	Whirlpool Corp	43.133	0,03
6.461	Williams Cos Inc/The	122.888	0,09
895	Workday Inc - Class A	167.687	0,12
890	WP Carey Inc (REIT)	60.209	0,04
240	WW Grainger Inc	75.398	0,05
527	Wynn Resorts Ltd	39.256	0,03
2.787	Xcel Energy Inc	174.188	0,13
1.318	Xilinx Inc	129.678	0,09
950	Xylem Inc/NY	61.712	0,05
1.899	Yum China Holdings Inc	91.285	0,07
1.597	Yum! Brands Inc	138.795	0,10
1.103	Zimmer Biomet Holdings Inc	131.654	0,10
2.535	Zoetis Inc	347.396	0,25
630	Zoom Video Communications Inc	159.730	0,12
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>132.256.867</b>	<b>96,37</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>137.130.983</b>	<b>99,89</b>

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

Zum 30. Juni 2020

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	137.130.983	99,89
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	155.325	0,11
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>137.286.308</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,88
Sonstige Vermögenswerte		0,12
		<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,26 %)</b>			
<b>Irland</b>			
795	DCC Plc	53.504	0,49
<b>Irland insgesamt</b>		<b>53.504</b>	<b>0,49</b>
<b>Jersey</b>			
1.438	Clarivate Plc	25.988	0,24
6.569	Experian Plc	185.180	1,69
1.629	Ferguson Plc	107.710	0,98
8.598	WPP Plc	54.236	0,49
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>373.114</b>	<b>3,40</b>
<b>Niederlande</b>			
7.129	CNH Industrial NV	40.359	0,37
7.980	Fiat Chrysler Automobiles NV	64.879	0,59
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>105.238</b>	<b>0,96</b>
<b>Spanien</b>			
10.597	International Consolidated Airlines Group SA	23.547	0,21
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>23.547</b>	<b>0,21</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
7.031	3i Group Plc	58.540	0,53
1.802	Admiral Group Plc	41.428	0,38
8.378	Anglo American Plc	156.618	1,43
2.767	Antofagasta Plc	25.943	0,24
3.239	Ashtead Group Plc	88.068	0,80
2.583	Associated British Foods Plc	49.464	0,45
9.137	AstraZeneca Plc	769.427	7,02
6.561	Auto Trader Group Plc '144A'	34.537	0,31
579	AVEVA Group Plc	23.693	0,22

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
32.337	Aviva Plc	88.474	0,81
23.606	BAE Systems Plc	114.111	1,04
122.486	Barclays Plc	140.149	1,28
7.591	Barratt Developments Plc	37.644	0,34
885	Berkeley Group Holdings Plc	36.860	0,34
14.801	BHP Group Plc	244.868	2,23
147.384	BP Plc	452.764	4,13
16.542	British American Tobacco Plc	513.546	4,68
7.045	British Land Co Plc/The (REIT)	27.222	0,25
58.583	BT Group Plc	66.814	0,61
2.377	Bunzl Plc	51.486	0,47
3.006	Burberry Group Plc	48.081	0,44
1.546	Carnival Plc	15.241	0,14
1.293	Coca-Cola European Partners Plc	39.514	0,36
11.683	Compass Group Plc	129.915	1,18
7.929	ConvaTec Group Plc '144A'	15.509	0,14
880	Croda International Plc	46.253	0,42
16.809	Diageo Plc	450.733	4,11
10.337	Direct Line Insurance Group Plc	28.013	0,26
8.657	DS Smith Plc	28.412	0,26
1.943	easyJet Plc	13.212	0,12
5.149	Evraz Plc	14.850	0,14
954	Fresnillo Plc	8.027	0,07
36.298	GlaxoSmithKline Plc	594.053	5,42
2.562	Halma Plc	59.003	0,54
2.243	Hargreaves Lansdown Plc	36.527	0,33
1.060	Hikma Pharmaceuticals Plc	23.532	0,21
147.462	HSBC Holdings Plc	558.291	5,09
6.736	Imperial Brands Plc	103.633	0,95

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
9.560	Informa Plc	44.970	0,41
1.268	InterContinental Hotels Group Plc	45.230	0,41
1.143	Intertek Group Plc	62.179	0,57
26.170	ITV Plc	19.544	0,18
15.119	J Sainsbury Plc	31.553	0,29
3.063	JD Sports Fashion Plc	19.058	0,17
1.333	Johnson Matthey Plc	27.966	0,26
14.521	Kingfisher Plc	32.062	0,29
6.227	Land Securities Group Plc (REIT)	34.435	0,31
43.876	Legal & General Group Plc	96.922	0,88
3.348	Liberty Global Plc	58.284	0,53
268	Liberty Global Plc	4.741	0,04
511.566	Lloyds Banking Group Plc	159.481	1,45
2.516	London Stock Exchange Group Plc	210.287	1,92
19.755	M&G Plc	33.100	0,30
10.280	Marks & Spencer Group Plc	10.177	0,09
31.428	Melrose Industries Plc	35.828	0,33
4.357	Mondi Plc	65.813	0,60
25.542	National Grid Plc	252.662	2,30
939	Next Plc	45.955	0,42
658	NMC Health Plc*	6.175	0,06
3.110	Ocado Group Plc	63.071	0,58
5.379	Pearson Plc	30.972	0,28
2.352	Persimmon Plc	53.767	0,49
18.945	Prudential Plc	230.845	2,11
5.087	Reckitt Benckiser Group Plc	378.066	3,45
13.976	RELX Plc	261.351	2,38
13.294	Rentokil Initial Plc	67.746	0,62
7.677	Rio Tinto Plc	349.227	3,19



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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert £	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
14.736	Rolls-Royce Holdings Plc	42.057	0,38
33.134	Royal Bank of Scotland Group Plc	40.291	0,37
25.268	Royal Dutch Shell Plc	309.280	2,82
29.561	Royal Dutch Shell Plc	380.450	3,47
7.239	RSA Insurance Group Plc	29.665	0,27
7.350	Sage Group Plc/The	49.377	0,45
759	Schroders Plc	22.383	0,20
7.732	Segro Plc (REIT)	69.201	0,63
1.685	Severn Trent Plc	41.771	0,38
6.451	Smith & Nephew Plc	97.120	0,89
2.803	Smiths Group Plc	39.578	0,36
619	Spirax-Sarco Engineering Plc	61.751	0,56
7.273	SSE Plc	99.240	0,91
3.632	St James's Place Plc	34.606	0,32
22.614	Standard Chartered Plc	99.524	0,91
16.631	Standard Life Aberdeen Plc	44.505	0,41
23.699	Taylor Wimpey Plc	33.795	0,31
3.307	TechnipFMC Plc	18.307	0,17
69.488	Tesco Plc	158.502	1,45
7.972	Unilever Plc	347.181	3,17
4.922	United Utilities Group Plc	44.800	0,41
192.794	Vodafone Group Plc	248.434	2,27
1.351	Weir Group Plc/The	14.368	0,13
1.475	Whitbread Plc	32.775	0,30
15.048	Wm Morrison Supermarkets Plc	28.674	0,26
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>10.353.557</b>	<b>94,45</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>10.908.960</b>	<b>99,51</b>

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

Zum 30. Juni 2020

Gesamtanlagen	Wert £	% des Nettover- mögens
Stammaktien	10.908.960	99,51
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	53.735	0,49
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>10.962.695</b>	<b>100,00</b>
Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,51
Sonstige Vermögenswerte		0,49
		<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

\* Der Handel dieses Wertpapiers wurde ausgesetzt.

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %)</b>			
<b>Japan</b>			
900	ABC-Mart Inc	52.642	0,05
12.000	Acom Co Ltd	45.715	0,04
49	Advance Residence Investment Corp (REIT)	146.021	0,13
6.900	Advantest Corp	391.417	0,34
22.700	Aeon Co Ltd	527.075	0,45
3.200	AEON Financial Service Co Ltd	34.852	0,03
3.400	Aeon Mall Co Ltd	45.067	0,04
6.500	AGC Inc/Japan	184.664	0,16
6.800	Air Water Inc	95.869	0,08
5.500	Aisin Seiki Co Ltd	160.078	0,14
17.700	Ajinomoto Co Inc	294.002	0,25
6.300	Alfresa Holdings Corp	131.448	0,11
6.700	Alps Alpine Co Ltd	85.702	0,07
13.900	Amada Co Ltd	113.509	0,10
10.000	ANA Holdings Inc	227.186	0,19
4.300	Aozora Bank Ltd	74.772	0,06
13.600	Asahi Group Holdings Ltd	476.006	0,41
6.500	Asahi Intecc Co Ltd	184.664	0,16
42.200	Asahi Kasei Corp	342.497	0,29
63.400	Astellas Pharma Inc	1.057.499	0,91
6.500	Bandai Namco Holdings Inc	341.436	0,29
2.200	Benesse Holdings Inc	58.933	0,05
18.800	Bridgestone Corp	604.507	0,52
8.700	Brother Industries Ltd	156.606	0,13
2.800	Calbee Inc	77.419	0,07
34.700	Canon Inc	686.538	0,59
2.907	Capcom Co Ltd	105.626	0,09
7.000	Casio Computer Co Ltd	121.333	0,10
5.800	Central Japan Railway Co	897.270	0,77

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
24.700	Chiba Bank Ltd/The	116.305	0,10
24.900	Chubu Electric Power Co Inc	312.043	0,27
21.000	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	1.122.167	0,96
10.700	Chugoku Electric Power Co Inc/The	142.918	0,12
3.900	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	70.636	0,06
35.400	Concordia Financial Group Ltd	113.204	0,10
600	Cosmos Pharmaceutical Corp	91.987	0,08
5.500	Credit Saison Co Ltd	62.808	0,05
3.400	CyberAgent Inc	166.715	0,14
7.500	Dai Nippon Printing Co Ltd	171.644	0,15
9.500	Daicel Corp	73.351	0,06
3.500	Daifuku Co Ltd	305.603	0,26
36.300	Dai-ichi Life Holdings Inc	431.690	0,37
21.200	Daiichi Sankyo Co Ltd	1.730.432	1,49
8.800	Daikin Industries Ltd	1.413.992	1,21
2.000	Daito Trust Construction Co Ltd	183.696	0,16
20.200	Daiwa House Industry Co Ltd	475.955	0,41
71	Daiwa House REIT Investment Corp (REIT)	167.159	0,14
49.100	Daiwa Securities Group Inc	204.665	0,18
14.600	Denso Corp	569.060	0,49
6.700	Dentsu Group Inc	158.674	0,14
2.700	DIC Corp	67.597	0,06
1.000	Disco Corp	241.832	0,21
12.100	East Japan Railway Co	838.257	0,72
3.300	Ebara Corp	77.235	0,07
9.200	Eisai Co Ltd	728.771	0,63
6.400	Electric Power Development Co Ltd	121.314	0,10
94.700	ENEOS Holdings Inc	335.314	0,29
1.100	Ezaki Glico Co Ltd	52.408	0,04

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
8.400	FamilyMart Co Ltd	143.964	0,12
6.400	FANUC Corp	1.142.550	0,98
1.800	Fast Retailing Co Ltd	1.029.430	0,88
4.100	Fuji Electric Co Ltd	111.882	0,10
6.200	Fuji Media Holdings Inc	59.652	0,05
12.700	FUJIFILM Holdings Corp	542.680	0,47
6.300	Fujitsu Ltd	736.951	0,63
5.700	Fukuoka Financial Group Inc	89.871	0,08
130	GLP J-Reit (REIT)	188.580	0,16
1.500	GMO Payment Gateway Inc	156.278	0,13
6.800	Hakuhodo DY Holdings Inc	80.742	0,07
4.700	Hamamatsu Photonics KK	203.448	0,17
8.400	Hankyu Hanshin Holdings Inc	283.802	0,24
1.000	Harmonic Drive Systems Inc	54.781	0,05
8.600	Haseko Corp	108.252	0,09
700	Hikari Tsushin Inc	159.290	0,14
9.300	Hino Motors Ltd	62.756	0,05
1.000	Hirose Electric Co Ltd	109.561	0,09
2.200	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	118.478	0,10
3.300	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	91.153	0,08
31.600	Hitachi Ltd	996.754	0,86
6.500	Hitachi Metals Ltd	77.300	0,07
54.400	Honda Motor Co Ltd	1.389.435	1,19
1.600	Hoshizaki Corp	137.035	0,12
12.800	Hoya Corp	1.217.296	1,05
13.700	Hulic Co Ltd	128.511	0,11
5.940	Idemitsu Kosan Co Ltd	125.919	0,11
4.100	IHI Corp	59.209	0,05

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
4.800	Iida Group Holdings Co Ltd	73.456	0,06
31.600	Inpex Corp	195.338	0,17
10.700	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	61.293	0,05
17.700	Isuzu Motors Ltd	159.683	0,14
1.800	Ito En Ltd	101.441	0,09
48.900	ITOCHU Corp	1.052.244	0,90
3.500	Itochu Techno-Solutions Corp	131.065	0,11
1.000	Izumi Co Ltd	31.608	0,03
9.100	J Front Retailing Co Ltd	60.563	0,05
10.800	Japan Airlines Co Ltd	194.409	0,17
17.200	Japan Exchange Group Inc	397.297	0,34
16.869	Japan Post Bank Co Ltd	125.401	0,11
52.600	Japan Post Holdings Co Ltd	373.809	0,32
7.600	Japan Post Insurance Co Ltd	99.539	0,09
44	Japan Real Estate Investment Corp (REIT)	225.536	0,19
92	Japan Retail Fund Investment Corp (REIT)	114.696	0,10
35.500	Japan Tobacco Inc	658.602	0,57
17.300	JFE Holdings Inc	123.795	0,11
8.400	JGC Holdings Corp	88.294	0,08
7.300	JSR Corp	140.742	0,12
6.800	JTEKT Corp	52.756	0,05
14.900	Kajima Corp	177.333	0,15
4.200	Kakaku.com Inc	106.241	0,09
27.000	Kansai Electric Power Co Inc/The	261.528	0,22
7.300	Kansai Paint Co Ltd	153.805	0,13
16.100	Kao Corp	1.274.450	1,09
5.700	Kawasaki Heavy Industries Ltd	81.893	0,07
53.800	KDDI Corp	1.612.731	1,38

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
3.300	Keihan Holdings Co Ltd	146.976	0,13
9.300	Keikyu Corp	142.321	0,12
3.900	Keio Corp	222.682	0,19
4.300	Keisei Electric Railway Co Ltd	134.518	0,12
1.800	Kewpie Corp	33.953	0,03
6.000	Keyence Corp	2.504.338	2,15
4.700	Kikkoman Corp	226.102	0,19
6.400	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	287.417	0,25
25.900	Kirin Holdings Co Ltd	546.040	0,47
1.800	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	158.168	0,14
1.916	Kobe Bussan Co Ltd	107.979	0,09
3.800	Koito Manufacturing Co Ltd	152.866	0,13
31.400	Komatsu Ltd	641.330	0,55
2.900	Konami Holdings Corp	96.501	0,08
19.300	Konica Minolta Inc	66.549	0,06
1.000	Kose Corp	120.128	0,10
38.100	Kubota Corp	567.871	0,49
11.700	Kuraray Co Ltd	122.005	0,10
10.600	Kyocera Corp	576.253	0,49
8.100	Kyowa Kirin Co Ltd	212.401	0,18
14.600	Kyushu Electric Power Co Inc	122.473	0,11
4.600	Kyushu Railway Co	119.344	0,10
2.651	Lasertec Corp (Units)	249.656	0,21
1.500	Lawson Inc	75.219	0,06
1.700	LINE Corp	85.408	0,07
8.100	Lion Corp	194.232	0,17
10.000	LIXIL Group Corp	139.593	0,12
13.500	M3 Inc	573.736	0,49

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
1.000	Mabuchi Motor Co Ltd	31.793	0,03
7.600	Makita Corp	275.794	0,24
61.000	Marubeni Corp	275.641	0,24
6.300	Marui Group Co Ltd	113.638	0,10
2.700	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	97.979	0,08
17.700	Mazda Motor Corp	105.985	0,09
1.900	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	102.498	0,09
36.700	Mebuki Financial Group Inc	85.044	0,07
5.600	Medipal Holdings Corp	107.759	0,09
5.200	MEIJI Holdings Co Ltd	413.551	0,35
3.100	Mercari Inc	95.685	0,08
14.300	MINEBEA MITSUMI Inc	258.867	0,22
9.200	MISUMI Group Inc	229.734	0,20
49.200	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	286.120	0,25
46.200	Mitsubishi Corp	972.091	0,83
64.300	Mitsubishi Electric Corp	834.109	0,72
40.000	Mitsubishi Estate Co Ltd	594.151	0,51
5.500	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	83.098	0,07
10.300	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	242.785	0,21
3.400	Mitsubishi Materials Corp	71.697	0,06
383.300	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	1.497.885	1,29
18.900	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	89.345	0,08
55.200	Mitsui & Co Ltd	815.835	0,70
5.800	Mitsui Chemicals Inc	120.801	0,10
30.600	Mitsui Fudosan Co Ltd	541.605	0,46
3.800	Mitsui OSK Lines Ltd	67.205	0,06
3.336	Miura Co Ltd	138.684	0,12
761.600	Mizuho Financial Group Inc	933.249	0,80



## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
4.400	MonotaRO Co Ltd	176.188	0,15
15.600	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	428.156	0,37
20.400	Murata Manufacturing Co Ltd	1.194.294	1,03
3.800	Nabtesco Corp	116.939	0,10
6.200	Nagoya Railroad Co Ltd	174.992	0,15
8.600	NEC Corp	412.124	0,35
14.500	Nexon Co Ltd	327.539	0,28
10.300	NGK Insulators Ltd	142.062	0,12
7.900	NGK Spark Plug Co Ltd	113.061	0,10
3.400	NH Foods Ltd	136.303	0,12
3.300	Nichirei Corp	95.894	0,08
17.100	Nidec Corp	1.140.581	0,98
5.100	Nihon M&A Center Inc	230.217	0,20
10.800	Nikon Corp	90.296	0,08
4.000	Nintendo Co Ltd	1.780.048	1,53
44	Nippon Building Fund Inc (REIT)	250.415	0,21
2.600	Nippon Express Co Ltd	134.477	0,12
5.700	Nippon Paint Holdings Co Ltd	414.219	0,36
75	Nippon Prologis REIT Inc (REIT)	228.021	0,20
1.700	Nippon Shinyaku Co Ltd	138.193	0,12
29.600	Nippon Steel Corp	278.070	0,24
79.800	Nippon Telegraph & Telephone Corp	1.860.656	1,60
3.800	Nippon Television Holdings Inc	41.070	0,04
3.900	Nippon Yusen KK	54.803	0,05
4.000	Nissan Chemical Corp	204.662	0,18
84.500	Nissan Motor Co Ltd	312.670	0,27
7.800	Nisshin Seifun Group Inc	116.329	0,10
2.100	Nissin Foods Holdings Co Ltd	185.892	0,16

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
3.000	Nitori Holdings Co Ltd	587.431	0,50
4.600	Nitto Denko Corp	260.092	0,22
2.700	NOK Corp	33.361	0,03
104.000	Nomura Holdings Inc	465.029	0,40
3.300	Nomura Real Estate Holdings Inc	61.176	0,05
138	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	165.521	0,14
12.400	Nomura Research Institute Ltd	336.421	0,29
16.700	NSK Ltd	123.681	0,11
22.300	NTT Data Corp	247.835	0,21
36.000	NTT DOCOMO Inc	961.693	0,83
22.100	Obayashi Corp	206.487	0,18
2.200	Obic Co Ltd	384.799	0,33
11.100	Odakyu Electric Railway Co Ltd	272.754	0,23
33.900	Oji Holdings Corp	157.426	0,14
41.900	Olympus Corp	806.075	0,69
6.100	Omron Corp	408.231	0,35
13.300	Ono Pharmaceutical Co Ltd	386.731	0,33
1.200	Oracle Corp Japan	141.484	0,12
6.700	Oriental Land Co Ltd/Japan	884.352	0,76
41.400	ORIX Corp	509.801	0,44
93	Orix JREIT Inc (REIT)	121.891	0,10
14.600	Osaka Gas Co Ltd	287.981	0,25
3.500	Otsuka Corp	184.270	0,16
13.500	Otsuka Holdings Co Ltd	588.004	0,50
12.900	Pan Pacific International Holdings Corp	283.266	0,24
72.600	Panasonic Corp	632.297	0,54
3.400	Park24 Co Ltd	58.145	0,05
3.200	PeptiDream Inc	146.526	0,13

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
6.200	Persol Holdings Co Ltd	85.054	0,07
3.600	Pigeon Corp	139.148	0,12
2.700	Pola Orbis Holdings Inc	46.952	0,04
28.000	Rakuten Inc	246.040	0,21
41.400	Recruit Holdings Co Ltd	1.412.938	1,21
28.900	Renesas Electronics Corp	147.601	0,13
76.200	Resona Holdings Inc	259.783	0,22
22.500	Ricoh Co Ltd	160.379	0,14
1.100	Rinnai Corp	91.764	0,08
3.100	Rohm Co Ltd	205.163	0,18
7.600	Ryohin Keikaku Co Ltd	107.429	0,09
12.400	Santen Pharmaceutical Co Ltd	227.923	0,20
7.900	SBI Holdings Inc/Japan	170.470	0,15
1.800	SCREEN Holdings Co Ltd	83.923	0,07
1.800	SCSK Corp	87.426	0,07
6.800	Secom Co Ltd	593.932	0,51
6.300	Sega Sammy Holdings Inc	75.330	0,06
11.600	Seibu Holdings Inc	125.908	0,11
10.200	Seiko Epson Corp	116.574	0,10
13.000	Sekisui Chemical Co Ltd	185.809	0,16
18.600	Sekisui House Ltd	353.863	0,30
25.400	Seven & i Holdings Co Ltd	828.737	0,71
11.600	Seven Bank Ltd	31.719	0,03
6.800	SG Holdings Co Ltd	221.866	0,19
8.900	Sharp Corp/Japan	94.540	0,08
9.300	Shimadzu Corp	247.230	0,21
600	Shimamura Co Ltd	40.599	0,03
2.600	Shimano Inc	500.070	0,43

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
20.000	Shimizu Corp	164.064	0,14
14.000	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	1.634.426	1,40
7.800	Shinsei Bank Ltd	93.844	0,08
9.900	Shionogi & Co Ltd	619.410	0,53
13.000	Shiseido Co Ltd	823.609	0,71
26.500	Shizuoka Bank Ltd/The	170.223	0,15
4.400	Showa Denko KK	98.535	0,08
2.100	SMC Corp/Japan	1.074.088	0,92
56.500	Softbank Corp	720.095	0,62
50.900	SoftBank Group Corp	2.571.305	2,21
2.300	Sohgo Security Services Co Ltd	107.021	0,09
43.800	Sojitz Corp	95.407	0,08
11.200	Sompo Holdings Inc	384.839	0,33
41.400	Sony Corp	2.833.551	2,43
4.700	Sony Financial Holdings Inc	113.051	0,10
2.700	Square Enix Holdings Co Ltd	136.145	0,12
4.800	Stanley Electric Co Ltd	115.456	0,10
20.800	Subaru Corp	432.156	0,37
9.600	SUMCO Corp	146.734	0,13
62.400	Sumitomo Chemical Co Ltd	186.243	0,16
40.900	Sumitomo Corp	468.008	0,40
5.900	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	81.485	0,07
26.100	Sumitomo Electric Industries Ltd	299.870	0,26
4.100	Sumitomo Heavy Industries Ltd	89.118	0,08
8.200	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	228.705	0,20
43.500	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	1.222.529	1,05
10.100	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	283.195	0,24
10.800	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	296.616	0,25

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
4.400	Sumitomo Rubber Industries Ltd	43.313	0,04
2.500	Sundrug Co Ltd	82.727	0,07
3.900	Suntory Beverage & Food Ltd	152.009	0,13
2.400	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	89.429	0,08
13.500	Suzuki Motor Corp	457.612	0,39
5.600	Systemex Corp	427.196	0,37
18.600	T&D Holdings Inc	158.786	0,14
4.000	Taiheiyo Cement Corp	92.395	0,08
6.200	Taisei Corp	225.277	0,19
1.200	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	73.412	0,06
5.600	Taiyo Nippon Sanso Corp	93.485	0,08
51.900	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	1.851.149	1,59
4.300	TDK Corp	425.676	0,37
4.300	Teijin Ltd	68.315	0,06
24.000	Terumo Corp	907.859	0,78
4.200	THK Co Ltd	103.710	0,09
8.449	TIS Inc	178.088	0,15
7.100	Tobu Railway Co Ltd	234.616	0,20
3.400	Toho Co Ltd/Tokyo	122.755	0,11
3.500	Toho Gas Co Ltd	175.187	0,15
15.700	Tohoku Electric Power Co Inc	149.309	0,13
21.400	Tokio Marine Holdings Inc	931.892	0,80
3.400	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	54.237	0,05
1.300	Tokyo Century Corp	66.395	0,06
4.800	Tokyo Electron Ltd	1.176.364	1,01
14.100	Tokyo Gas Co Ltd	337.192	0,29
21.600	Tokyu Corp	303.723	0,26
22.700	Tokyu Fudosan Holdings Corp	106.046	0,09

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
9.500	Toppan Printing Co Ltd	158.241	0,14
50.100	Toray Industries Inc	235.675	0,20
10.900	Tosoh Corp	148.519	0,13
5.100	TOTO Ltd	194.527	0,17
4.500	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	50.721	0,04
2.800	Toyo Suisan Kaisha Ltd	156.500	0,13
2.000	Toyoda Gosei Co Ltd	41.563	0,04
700	Toyota Boshoku Corp	9.389	0,01
5.500	Toyota Industries Corp	291.097	0,25
76.100	Toyota Motor Corp	4.769.785	4,10
8.200	Toyota Tsusho Corp	207.423	0,18
4.200	Trend Micro Inc/Japan	234.361	0,20
1.200	Tsuruha Holdings Inc	165.176	0,14
14.700	Unicharm Corp	602.252	0,52
102	United Urban Investment Corp (REIT)	109.483	0,09
6.200	USS Co Ltd	99.021	0,08
1.700	Welcia Holdings Co Ltd	136.933	0,12
6.200	West Japan Railway Co	347.455	0,30
502	Workman Co Ltd	44.065	0,04
4.000	Yakult Honsha Co Ltd	235.436	0,20
25.700	Yamada Denki Co Ltd	127.446	0,11
5.300	Yamaha Corp	249.071	0,21
8.300	Yamaha Motor Co Ltd	129.864	0,11
11.500	Yamato Holdings Co Ltd	248.369	0,21
4.900	Yamazaki Baking Co Ltd	84.297	0,07
8.400	Yaskawa Electric Corp	290.031	0,25
8.900	Yokogawa Electric Corp	138.592	0,12

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,85 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
3.600	Yokohama Rubber Co Ltd/The	50.520	0,04
87.300	Z Holdings Corp	425.637	0,37
3.300	ZOZO Inc	73.289	0,06
<b>Japan insgesamt</b>		<b>116.113.301</b>	<b>99,69</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>116.113.301</b>	<b>99,69</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		116.113.301	99,69
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		356.070	0,31
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>116.469.371</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			98,46
Sonstige Vermögenswerte			1,54
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

## L&G Global Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %)</b>			
<b>Australien</b>			
387	AGL Energy Ltd	4.543	0,01
718	APA Group	5.502	0,02
253	Aristocrat Leisure Ltd	4.442	0,01
184	ASX Ltd	10.816	0,03
5.832	Aurizon Holdings Ltd	19.756	0,06
2.181	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	27.991	0,09
2.222	BHP Group Ltd	54.800	0,17
492	BlueScope Steel Ltd	3.960	0,01
660	Brambles Ltd	4.940	0,02
40	Cochlear Ltd	5.203	0,02
449	Coles Group Ltd	5.308	0,02
2.311	Commonwealth Bank of Australia	110.457	0,34
347	Computershare Ltd	3.166	0,01
586	CSL Ltd	115.795	0,36
717	Dexus (Units) (REIT)	4.542	0,01
1.133	Fortescue Metals Group Ltd	10.804	0,03
695	Goodman Group (REIT)	7.106	0,02
1.363	GPT Group/The (REIT)	3.913	0,01
1.010	Insurance Australia Group Ltd	4.012	0,01
404	Lendlease Group	3.441	0,01
698	Macquarie Group Ltd	56.997	0,18
4.040	Mirvac Group (Units) (REIT)	6.036	0,02
2.094	National Australia Bank Ltd	26.268	0,08
335	Newcrest Mining Ltd	7.272	0,02
968	Origin Energy Ltd	3.892	0,01
1.243	Qantas Airways Ltd	3.235	0,01
615	QBE Insurance Group Ltd	3.752	0,01
382	Ramsay Health Care Ltd	17.495	0,05
331	Rio Tinto Ltd	22.325	0,07



## L&G Global Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Australien (Fortsetzung)</b>			
1.089	Santos Ltd	3.974	0,01
1.963	Scentre Group (REIT)	2.933	0,01
308	Sonic Healthcare Ltd	6.453	0,02
1.956	South32 Ltd	2.747	0,01
542	Suncorp Group Ltd	3.444	0,01
1.096	Sydney Airport	4.279	0,01
1.499	Tabcorp Holdings Ltd	3.488	0,01
9.050	Telstra Corp Ltd	19.503	0,06
2.009	Transurban Group	19.545	0,06
448	Treasury Wine Estates Ltd	3.233	0,01
956	Wesfarmers Ltd	29.508	0,09
2.548	Westpac Banking Corp	31.490	0,10
984	Woodside Petroleum Ltd	14.668	0,05
1.178	Woolworths Group Ltd	30.236	0,09
	<b>Australien insgesamt</b>	<b>733.270</b>	<b>2,25</b>
<b>Österreich</b>			
165	Erste Group Bank AG	3.883	0,01
107	OMV AG	3.577	0,01
	<b>Österreich insgesamt</b>	<b>7.460</b>	<b>0,02</b>
<b>Belgien</b>			
99	Ageas SA/NV	3.507	0,01
699	Anheuser-Busch InBev SA/NV	34.438	0,11
51	Galapagos NV	10.027	0,03
209	Groupe Bruxelles Lambert SA	17.531	0,05
314	KBC Group NV	18.008	0,06
43	Solvay SA	3.442	0,01
168	Telenet Group Holding NV	6.914	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Belgien (Fortsetzung)</b>			
60	UCB SA	6.948	0,02
104	Umicore SA	4.895	0,02
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>105.710</b>	<b>0,33</b>
<b>Bermuda</b>			
6.000	Alibaba Health Information Technology Ltd	17.496	0,05
180	Arch Capital Group Ltd	5.157	0,02
109	Athene Holding Ltd - Class A	3.400	0,01
1.600	China Gas Holdings Ltd	4.934	0,02
23	Everest Re Group Ltd	4.743	0,01
38	HAL Trust	5.395	0,02
800	Hongkong Land Holdings Ltd	3.304	0,01
382	IHS Markit Ltd	28.841	0,09
100	Jardine Matheson Holdings Ltd	4.174	0,01
100	Jardine Strategic Holdings Ltd	2.155	0,01
292	Marvell Technology Group Ltd	10.238	0,03
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>89.837</b>	<b>0,28</b>
<b>Kanada</b>			
100	Agnico Eagle Mines Ltd (Units)	6.382	0,02
400	Air Canada - Class A	4.978	0,02
1.300	Algonquin Power & Utilities Corp	16.751	0,05
800	Alimentation Couche-Tard Inc - Class B	25.004	0,08
400	Bank of Montreal	21.222	0,07
700	Bank of Nova Scotia/The	28.873	0,09
1.019	Barrick Gold Corp	27.330	0,08
600	BCE Inc	24.943	0,08
750	Brookfield Asset Management Inc - Class A	24.603	0,08
501	Canadian Apartment Properties REIT (Units) (REIT)	17.873	0,05

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Kanada (Fortsetzung)</b>			
300	Canadian Imperial Bank of Commerce	19.987	0,06
500	Canadian National Railway Co	44.093	0,14
1.000	Canadian Natural Resources Ltd	17.291	0,05
100	Canadian Pacific Railway Ltd	25.354	0,08
100	Canadian Tire Corp Ltd	8.637	0,03
100	Canopy Growth Corp	1.615	0,00
100	CCL Industries Inc - Class B	3.222	0,01
600	Cenovus Energy Inc	2.797	0,01
100	CGI Inc	6.280	0,02
200	Dollarama Inc	6.631	0,02
206	Emera Inc	8.080	0,02
1.900	Enbridge Inc	57.585	0,18
500	First Quantum Minerals Ltd	3.972	0,01
202	Fortis Inc/Canada	7.657	0,02
100	Franco-Nevada Corp	13.924	0,04
300	George Weston Ltd	21.905	0,07
200	Gildan Activewear Inc	3.088	0,01
200	Great-West Lifeco Inc	3.495	0,01
3.000	Husky Energy Inc	9.824	0,03
1.300	Hydro One Ltd '144A'	24.368	0,07
200	Imperial Oil Ltd	3.207	0,01
100	Intact Financial Corp	9.487	0,03
300	Inter Pipeline Ltd	2.784	0,01
500	Keyera Corp	7.588	0,02
1.500	Kinross Gold Corp	10.793	0,03
484	Kirkland Lake Gold Ltd	19.864	0,06
100	Loblaw Cos Ltd	4.854	0,01
300	Magna International Inc (Units)	13.317	0,04
1.445	Manulife Financial Corp	19.595	0,06

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Kanada (Fortsetzung)</b>			
200	Metro Inc/CN	8.223	0,03
300	National Bank of Canada	13.551	0,04
500	Nutrien Ltd	16.013	0,05
100	Onex Corp	4.503	0,01
200	Open Text Corp	8.465	0,03
500	Pembina Pipeline Corp	12.460	0,04
390	Power Corp of Canada	6.838	0,02
100	Restaurant Brands International Inc	5.425	0,02
1.000	RioCan Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	11.277	0,03
300	Rogers Communications Inc	12.015	0,04
1.700	Royal Bank of Canada	114.968	0,35
200	Saputo Inc	4.753	0,01
300	Shaw Communications Inc	4.877	0,01
100	Shopify Inc - Class A	94.696	0,29
900	SmartCentres Real Estate Investment Trust (REIT)	13.817	0,04
600	Sun Life Financial Inc	21.978	0,07
1.200	Suncor Energy Inc	20.167	0,06
619	TC Energy Corp	26.360	0,08
1.036	TELUS Corp	17.320	0,05
90	Thomson Reuters Corp	6.095	0,02
1.800	Toronto-Dominion Bank/The	80.074	0,25
200	Waste Connections Inc	18.677	0,06
302	Wheaton Precious Metals Corp	13.240	0,04
	<b>Kanada insgesamt</b>	<b>1.115.045</b>	<b>3,41</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
2.000	CK Asset Holdings Ltd	11.922	0,04
2.500	CK Hutchison Holdings Ltd	16.064	0,05
7.448	Geely Automobile Holdings Ltd	11.724	0,04

## L&G Global Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Cayman-Inseln (Fortsetzung)</b>			
278	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	4.315	0,01
1.200	Sands China Ltd	4.707	0,01
5.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	9.419	0,03
7.000	WH Group Ltd '144A'	5.997	0,02
1.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	4.774	0,01
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>68.922</b>	<b>0,21</b>
<b>Curacao</b>			
987	Schlumberger Ltd	18.151	0,06
<b>Curacao insgesamt</b>		<b>18.151</b>	<b>0,06</b>
<b>Dänemark</b>			
4	AP Moller - Maersk A/S - Class B	4.658	0,01
196	Carlsberg AS	25.891	0,08
48	Chr Hansen Holding A/S	4.948	0,02
54	Coloplast A/S	8.365	0,03
273	Danske Bank A/S	3.632	0,01
305	DSV PANALPINA A/S	37.220	0,11
34	Genmab A/S	11.374	0,03
1.268	Novo Nordisk A/S	82.050	0,25
101	Novozymes A/S	5.837	0,02
272	Orsted A/S '144A'	31.373	0,10
88	Vestas Wind Systems A/S	8.957	0,03
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>224.305</b>	<b>0,69</b>
<b>Finnland</b>			
116	Elisa Oyj	7.054	0,02
231	Fortum Oyj	4.386	0,01
697	Kone Oyj - Class B	47.926	0,15

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Finnland (Fortsetzung)</b>			
180	Neste Oyj	7.038	0,02
3.993	Nokia Oyj	17.439	0,05
2.231	Nordea Bank Abp	15.406	0,05
390	Sampo Oyj - Class A	13.413	0,04
333	Stora Enso Oyj	3.976	0,01
538	UPM-Kymmene Oyj	15.542	0,05
282	Wartsila OYJ Abp	2.331	0,01
	<b>Finnland insgesamt</b>	<b>134.511</b>	<b>0,41</b>
<b>Frankreich</b>			
107	Accor SA	2.910	0,01
24	Aeroports de Paris	2.464	0,01
312	Air Liquide SA	44.995	0,14
120	Amundi SA '144A'	9.394	0,03
3.440	AXA SA	71.911	0,22
805	BNP Paribas SA	31.980	0,10
2.517	Bolloré SA	7.904	0,02
132	Bouygues SA	4.509	0,01
145	Capgemini SE	16.604	0,05
252	Carrefour SA	3.893	0,01
996	Cie de Saint-Gobain	35.854	0,11
133	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	13.794	0,04
516	Credit Agricole SA	4.884	0,02
395	Danone SA	27.311	0,08
103	Dassault Systemes SE	17.769	0,05
299	Electricite de France SA	2.757	0,01
1.375	Engie SA	16.988	0,05
247	EssilorLuxottica SA	31.696	0,10
21	Hermes International	17.544	0,05

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (Fortsetzung)</b>			
53	Kering SA	28.826	0,09
113	Legrand SA	8.582	0,03
244	L'Oreal SA	78.297	0,24
237	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	103.948	0,32
1.621	Orange SA	19.381	0,06
136	Pernod Ricard SA	21.393	0,07
223	Peugeot SA	3.627	0,01
84	Publicis Groupe SA	2.718	0,01
264	Safran SA	26.455	0,08
1.033	Sanofi	105.175	0,32
386	Schneider Electric SE	42.869	0,13
657	Societe Generale SA	10.921	0,03
51	Sodexo SA	3.448	0,01
124	Teleperformance	31.462	0,10
45	Thales SA	3.633	0,01
2.146	TOTAL SA	81.891	0,25
122	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	6.873	0,02
374	Vinci SA	34.445	0,11
840	Vivendi SA	21.549	0,07
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>1.000.654</b>	<b>3,07</b>
<b>Deutschland</b>			
134	adidas AG	35.158	0,11
396	Allianz SE	80.842	0,25
648	BASF SE	36.303	0,11
952	Bayer AG	70.347	0,22
26	Bayerische Motoren Werke AG	1.659	0,01
451	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	21.873	0,07
48	Beiersdorf AG	5.451	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (Fortsetzung)</b>			
42	Continental AG	4.112	0,01
75	Covestro AG '144A'	2.851	0,01
616	Daimler AG	25.008	0,08
758	Deutsche Bank AG	7.206	0,02
143	Deutsche Boerse AG	25.867	0,08
794	Deutsche Post AG	29.028	0,09
2.373	Deutsche Telekom AG	39.833	0,12
153	Deutsche Wohnen SE	6.865	0,02
1.972	E.ON SE	22.182	0,07
568	Evonik Industries AG	14.424	0,04
86	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	7.370	0,02
310	Fresenius SE & Co KGaA	15.362	0,05
37	Hannover Rueck SE	6.375	0,02
73	HeidelbergCement AG	3.898	0,01
169	Henkel AG & Co KGaA	14.075	0,04
57	Henkel AG & Co KGaA - Preference	5.306	0,02
889	Infineon Technologies AG	20.844	0,06
52	Merck KGaA	6.033	0,02
85	MTU Aero Engines AG	14.717	0,05
118	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	30.668	0,09
75	Porsche Automobil Holding SE - Preference	4.310	0,01
583	RWE AG	20.371	0,06
748	SAP SE	104.445	0,32
839	Siemens AG	98.720	0,30
118	Siemens Healthineers AG '144A'	5.653	0,02
209	Symrise AG - Class A	24.296	0,07
389	Vonovia SE	23.847	0,07
167	Zalando SE '144A'	11.776	0,04
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>847.075</b>	<b>2,60</b>



## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Guernsey</b>			
79	Amdocs Ltd	4.810	0,01
<b>Guernsey insgesamt</b>		<b>4.810</b>	<b>0,01</b>
<b>Hongkong</b>			
10.400	AIA Group Ltd	97.016	0,30
1.600	Bank of East Asia Ltd/The	3.654	0,01
1.000	CLP Holdings Ltd	9.806	0,03
7.200	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	13.600	0,04
1.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	6.806	0,02
300	Hang Seng Bank Ltd	5.036	0,02
2.200	Henderson Land Development Co Ltd	8.345	0,03
6.930	Hong Kong & China Gas Co Ltd	10.730	0,03
1.000	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	42.578	0,13
2.500	Link REIT (Units) (REIT)	20.434	0,06
1.019	MTR Corp Ltd	5.279	0,02
1.000	New World Development Co Ltd	4.748	0,01
1.000	Power Assets Holdings Ltd	5.438	0,02
8.000	Sino Land Co Ltd	10.064	0,03
20.000	SJM Holdings Ltd	22.192	0,07
1.500	Sun Hung Kai Properties Ltd	19.151	0,06
500	Swire Pacific Ltd	2.651	0,01
1.000	Techtronic Industries Co Ltd	9.780	0,03
2.000	Wheelock & Co Ltd*	15.818	0,05
<b>Hongkong insgesamt</b>		<b>313.126</b>	<b>0,97</b>
<b>Irland</b>			
529	Accenture Plc - Class A	113.587	0,35
155	Aon Plc	29.853	0,09
723	CRH Plc	24.768	0,08

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland (Fortsetzung)</b>			
59	DCC Plc	4.906	0,02
324	Eaton Corp Plc	28.344	0,09
56	Flutter Entertainment Plc	7.359	0,02
535	James Hardie Industries Plc CDI	10.137	0,03
31	Jazz Pharmaceuticals Plc	3.421	0,01
708	Johnson Controls International plc	24.171	0,07
136	Kerry Group Plc	16.848	0,05
112	Kingspan Group Plc	7.214	0,02
499	Linde Plc	105.843	0,33
1.288	Medtronic Plc	118.110	0,36
69	Perrigo Co Plc	3.814	0,01
403	Ryanair Holdings Plc	4.823	0,01
111	Seagate Technology Plc	5.374	0,02
154	Smurfit Kappa Group Plc	5.148	0,02
195	Trane Technologies Plc	17.351	0,05
135	Willis Towers Watson Plc	26.588	0,08
	<b>Irland insgesamt</b>	<b>557.659</b>	<b>1,71</b>
<b>Israel</b>			
733	Bank Hapoalim BM	4.359	0,01
901	Bank Leumi Le-Israel BM	4.506	0,01
53	Check Point Software Technologies Ltd	5.694	0,02
0	Isracard Ltd	1	0,00
921	Matrix IT Ltd	19.557	0,06
48	Nice Ltd	8.944	0,03
1.205	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	14.505	0,04
89	Wix.com Ltd	22.804	0,07
	<b>Israel insgesamt</b>	<b>80.370</b>	<b>0,24</b>

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Italien</b>			
4.627	A2A SpA	6.551	0,02
1.349	Assicurazioni Generali SpA	20.409	0,06
248	Atlantia SpA	3.983	0,01
700	Banca Mediolanum SpA	5.024	0,02
361	Buzzi Unicem SpA	7.773	0,02
139	Buzzi Unicem SpA	1.727	0,01
5.114	Enel SpA	44.102	0,14
1.911	Eni SpA	18.223	0,06
1.622	FinecoBank Banca Fineco SpA	21.889	0,07
11.921	Intesa Sanpaolo SpA	22.810	0,07
559	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	4.012	0,01
137	Moncler SpA	5.238	0,02
4.087	Pirelli & C SpA '144A'	17.329	0,05
3.485	Saipem SpA	8.686	0,03
1.184	Snam SpA	5.764	0,02
8.192	Telecom Italia SpA/Milano	3.218	0,01
955	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	6.562	0,02
2.006	UniCredit SpA	18.448	0,06
	<b>Italien insgesamt</b>	<b>221.748</b>	<b>0,70</b>
<b>Japan</b>			
200	Advantest Corp	11.345	0,03
300	Aeon Co Ltd	6.966	0,02
200	AGC Inc/Japan	5.682	0,02
100	Aisin Seiki Co Ltd	2.911	0,01
300	Ajinomoto Co Inc	4.983	0,02
200	ANA Holdings Inc	4.544	0,01
700	Aozora Bank Ltd	12.172	0,04
200	Asahi Group Holdings Ltd	7.000	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
400	Asahi Intecc Co Ltd	11.364	0,03
500	Asahi Kasei Corp	4.058	0,01
1.900	Astellas Pharma Inc	31.692	0,10
100	Bandai Namco Holdings Inc	5.253	0,02
1.300	Bridgestone Corp	41.801	0,13
900	Canon Inc	17.806	0,05
100	Central Japan Railway Co	15.470	0,05
400	Chubu Electric Power Co Inc	5.013	0,02
300	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	16.031	0,05
1.300	Chugoku Electric Power Co Inc/The	17.364	0,05
1.100	Concordia Financial Group Ltd	3.518	0,01
100	CyberAgent Inc	4.903	0,02
200	Dai Nippon Printing Co Ltd	4.577	0,01
100	Daifuku Co Ltd	8.732	0,03
500	Dai-ichi Life Holdings Inc	5.946	0,02
400	Daiichi Sankyo Co Ltd	32.650	0,10
200	Daikin Industries Ltd	32.136	0,10
100	Daito Trust Construction Co Ltd	9.185	0,03
300	Daiwa House Industry Co Ltd	7.069	0,02
900	Daiwa Securities Group Inc	3.751	0,01
200	Denso Corp	7.795	0,02
100	Dentsu Group Inc	2.368	0,01
200	East Japan Railway Co	13.855	0,04
300	Eisai Co Ltd	23.764	0,07
1.400	ENEOS Holdings Inc	4.957	0,02
400	FamilyMart Co Ltd	6.855	0,02
100	FANUC Corp	17.852	0,05
100	Fast Retailing Co Ltd	57.191	0,18
200	FUJIFILM Holdings Corp	8.546	0,03

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
100	Fujitsu Ltd	11.698	0,04
10	GLP J-Reit (REIT)	14.506	0,04
200	Hankyu Hanshin Holdings Inc	6.757	0,02
800	Hitachi Ltd	25.234	0,08
1.100	Honda Motor Co Ltd	28.095	0,09
400	Hoya Corp	38.041	0,12
100	Idemitsu Kosan Co Ltd	2.120	0,01
1.900	Inpex Corp	11.745	0,04
400	Isuzu Motors Ltd	3.609	0,01
1.200	ITOCHEU Corp	25.822	0,08
500	Japan Airlines Co Ltd	9.000	0,03
300	Japan Exchange Group Inc	6.930	0,02
600	Japan Post Holdings Co Ltd	4.264	0,01
3	Japan Retail Fund Investment Corp (REIT)	3.740	0,01
1.500	Japan Tobacco Inc	27.828	0,09
300	JFE Holdings Inc	2.147	0,01
400	Kajima Corp	4.761	0,01
1.500	Kansai Electric Power Co Inc/The	14.529	0,04
400	Kao Corp	31.663	0,10
1.100	KDDI Corp	32.974	0,10
600	Keikyu Corp	9.182	0,03
100	Keio Corp	5.710	0,02
500	Keisei Electric Railway Co Ltd	15.642	0,05
200	Keyence Corp	83.478	0,26
100	Kikkoman Corp	4.811	0,01
100	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	4.491	0,01
400	Kirin Holdings Co Ltd	8.433	0,03
100	Koito Manufacturing Co Ltd	4.023	0,01
900	Komatsu Ltd	18.382	0,06

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
1.000	Kubota Corp	14.905	0,05
400	Kuraray Co Ltd	4.171	0,01
300	Kyocera Corp	16.309	0,05
2.500	Kyushu Electric Power Co Inc	20.971	0,06
300	Kyushu Railway Co	7.783	0,02
400	Lion Corp	9.592	0,03
300	M3 Inc	12.750	0,04
800	Mabuchi Motor Co Ltd	25.434	0,08
100	Makita Corp	3.629	0,01
800	Marubeni Corp	3.615	0,01
1.800	Mazda Motor Corp	10.778	0,03
100	MEIJI Holdings Co Ltd	7.953	0,02
300	MINEBEA MITSUMI Inc	5.431	0,02
200	MISUMI Group Inc	4.994	0,02
600	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	3.489	0,01
2.700	Mitsubishi Corp	56.810	0,17
1.600	Mitsubishi Electric Corp	20.755	0,06
600	Mitsubishi Estate Co Ltd	8.912	0,03
100	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	2.357	0,01
14.500	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	56.664	0,17
3.300	Mitsui & Co Ltd	48.773	0,15
1.000	Mitsui Fudosan Co Ltd	17.699	0,05
18.600	Mizuho Financial Group Inc	22.792	0,07
200	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	5.489	0,02
400	Murata Manufacturing Co Ltd	23.418	0,07
700	Nagoya Railroad Co Ltd	19.757	0,06
200	NEC Corp	9.584	0,03
400	Nexon Co Ltd	9.036	0,03
400	Nidec Corp	26.680	0,08

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
300	Nikon Corp	2.508	0,01
100	Nintendo Co Ltd	44.501	0,14
200	Nippon Paint Holdings Co Ltd	14.534	0,04
400	Nippon Steel Corp	3.758	0,01
1.600	Nippon Telegraph & Telephone Corp	37.306	0,11
100	Nissan Chemical Corp	5.117	0,02
1.000	Nissan Motor Co Ltd	3.700	0,01
1.000	Nisshin Seifun Group Inc	14.914	0,05
100	Nitori Holdings Co Ltd	19.581	0,06
100	Nitto Denko Corp	5.654	0,02
1.500	Nomura Holdings Inc	6.707	0,02
4	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	4.798	0,01
300	Nomura Research Institute Ltd	8.139	0,02
400	NTT Data Corp	4.445	0,01
800	NTT DOCOMO Inc	21.371	0,07
500	Obayashi Corp	4.672	0,01
100	Obic Co Ltd	17.491	0,05
200	Odakyu Electric Railway Co Ltd	4.914	0,02
800	Oji Holdings Corp	3.715	0,01
800	Olympus Corp	15.390	0,05
100	Omron Corp	6.692	0,02
200	Ono Pharmaceutical Co Ltd	5.815	0,02
300	Oriental Land Co Ltd/Japan	39.598	0,12
1.400	ORIX Corp	17.240	0,05
300	Osaka Gas Co Ltd	5.917	0,02
200	Otsuka Holdings Co Ltd	8.711	0,03
400	Pan Pacific International Holdings Corp	8.783	0,03
2.500	Panasonic Corp	21.773	0,07
200	PeptiDream Inc	9.158	0,03

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
100	Pigeon Corp	3.865	0,01
700	Rakuten Inc	6.151	0,02
900	Recruit Holdings Co Ltd	30.716	0,09
1.000	Resona Holdings Inc	3.409	0,01
500	Ricoh Co Ltd	3.564	0,01
100	Rohm Co Ltd	6.618	0,02
300	Santen Pharmaceutical Co Ltd	5.514	0,02
200	SBI Holdings Inc/Japan	4.316	0,01
100	SCSK Corp	4.857	0,01
100	Secom Co Ltd	8.734	0,03
600	Seibu Holdings Inc	6.512	0,02
300	Sekisui Chemical Co Ltd	4.288	0,01
300	Sekisui House Ltd	5.707	0,02
600	Seven & i Holdings Co Ltd	19.576	0,06
200	Shimadzu Corp	5.317	0,02
100	Shimano Inc	19.233	0,06
300	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	35.023	0,11
200	Shionogi & Co Ltd	12.513	0,04
400	Shiseido Co Ltd	25.342	0,08
100	Showa Denko KK	2.239	0,01
100	SMC Corp/Japan	51.147	0,16
2.000	Softbank Corp	25.490	0,08
1.200	SoftBank Group Corp	60.620	0,19
1.400	Sojitz Corp	3.050	0,01
200	Sompo Holdings Inc	6.872	0,02
1.000	Sony Corp	68.443	0,21
200	Square Enix Holdings Co Ltd	10.085	0,03
300	Subaru Corp	6.233	0,02
1.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	2.985	0,01



## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
1.300	Sumitomo Corp	14.876	0,05
400	Sumitomo Electric Industries Ltd	4.596	0,01
200	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	5.578	0,02
1.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	28.104	0,09
200	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	5.608	0,02
200	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	5.493	0,02
4.500	Sumitomo Rubber Industries Ltd	44.297	0,14
100	Suntory Beverage & Food Ltd	3.898	0,01
200	Suzuki Motor Corp	6.779	0,02
100	Systemex Corp	7.628	0,02
300	T&D Holdings Inc	2.561	0,01
100	Taisei Corp	3.633	0,01
1.400	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	49.935	0,15
100	TDK Corp	9.899	0,03
600	Terumo Corp	22.696	0,07
200	Tobu Railway Co Ltd	6.609	0,02
100	Toho Gas Co Ltd	5.005	0,02
2.400	Tohoku Electric Power Co Inc	22.824	0,07
600	Tokio Marine Holdings Inc	26.128	0,08
100	Tokyo Electron Ltd	24.508	0,08
200	Tokyo Gas Co Ltd	4.783	0,01
300	Tokyu Corp	4.218	0,01
700	Toray Industries Inc	3.293	0,01
100	TOTO Ltd	3.814	0,01
100	Toyota Industries Corp	5.293	0,02
2.100	Toyota Motor Corp	131.623	0,40
100	Toyota Tsusho Corp	2.530	0,01
100	Trend Micro Inc/Japan	5.580	0,02
200	Unicharm Corp	8.194	0,03

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Japan (Fortsetzung)</b>			
500	USS Co Ltd	7.985	0,02
100	West Japan Railway Co	5.604	0,02
100	Yakult Honsha Co Ltd	5.886	0,02
100	Yamaha Corp	4.699	0,01
300	Yamaha Motor Co Ltd	4.694	0,01
200	Yamato Holdings Co Ltd	4.319	0,01
200	Yaskawa Electric Corp	6.905	0,02
1.700	Z Holdings Corp	8.288	0,03
<b>Japan insgesamt</b>		<b>2.750.934</b>	<b>8,48</b>
<b>Jersey</b>			
1.784	Amcor Plc	18.215	0,06
220	Aptiv Plc	17.142	0,05
876	Experian Plc	30.512	0,09
178	Ferguson Plc	14.542	0,04
8.958	Glencore Plc	18.951	0,06
444	WPP Plc	3.461	0,01
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>102.823</b>	<b>0,31</b>
<b>Liberia</b>			
144	Royal Caribbean Cruises Ltd	7.243	0,02
<b>Liberia insgesamt</b>		<b>7.243</b>	<b>0,02</b>
<b>Luxemburg</b>			
653	ArcelorMittal SA	6.872	0,02
88	Millicom International Cellular SA SDR	2.303	0,01
149	Spotify Technology SA	38.470	0,12
326	Tenaris SA	2.105	0,01
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>49.750</b>	<b>0,16</b>

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Niederlande</b>			
196	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A'	1.688	0,01
8	Adyen NV '144A'	11.641	0,04
102	AerCap Holdings NV	3.142	0,01
595	Airbus SE	42.450	0,13
86	Akzo Nobel NV	7.702	0,02
357	ASML Holding NV	131.078	0,40
474	CNH Industrial NV	3.316	0,01
86	EXOR NV	4.911	0,02
45	Ferrari NV	7.675	0,02
915	Fiat Chrysler Automobiles NV	9.192	0,03
57	Heineken Holding NV	4.664	0,01
245	Heineken NV	22.581	0,07
3.001	ING Groep NV	20.891	0,06
198	Just Eat Takeaway.com NV '144A'	20.629	0,06
790	Koninklijke Ahold Delhaize NV	21.526	0,07
275	Koninklijke DSM NV	38.053	0,12
1.850	Koninklijke KPN NV	4.904	0,02
706	Koninklijke Philips NV	32.924	0,10
253	LyondellBasell Industries NV	16.627	0,05
626	Mylan NV	10.066	0,03
131	NN Group NV	4.399	0,01
262	NXP Semiconductors NV	29.878	0,09
465	Prosus NV	43.213	0,13
102	Randstad NV	4.544	0,01
331	STMicroelectronics NV	9.004	0,03
1.386	Unilever NV	73.555	0,23
113	Wolters Kluwer NV	8.823	0,03
	<b>Niederlande insgesamt</b>	<b>589.076</b>	<b>1,81</b>

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Neuseeland</b>			
802	a2 Milk Co Ltd	10.424	0,03
1.041	Auckland International Airport Ltd	4.403	0,01
546	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	12.513	0,04
2.145	Infratil Ltd	6.490	0,02
1.884	Spark New Zealand Ltd	5.531	0,02
	<b>Neuseeland insgesamt</b>	<b>39.361</b>	<b>0,12</b>
<b>Norwegen</b>			
417	DNB ASA	5.494	0,02
1.298	Equinor ASA	18.380	0,06
202	Mowi ASA	3.825	0,01
925	Norsk Hydro ASA	2.548	0,01
587	Orkla ASA	5.129	0,02
527	Schibsted ASA	13.701	0,04
151	Schibsted ASA - Class B	3.547	0,01
296	Telenor ASA	4.299	0,01
934	TGS NOPEC Geophysical Co ASA	13.492	0,04
113	Yara International ASA	3.911	0,01
	<b>Norwegen insgesamt</b>	<b>74.326</b>	<b>0,23</b>
<b>Panama</b>			
337	Carnival Corp	5.534	0,02
	<b>Panama insgesamt</b>	<b>5.534</b>	<b>0,02</b>
<b>Papua-Neuguinea</b>			
918	Oil Search Ltd	2.004	0,01
	<b>Papua-Neuguinea insgesamt</b>	<b>2.004</b>	<b>0,01</b>

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Portugal</b>			
1.417	EDP - Energias de Portugal SA	6.764	0,02
292	Galp Energia SGPS SA	3.376	0,01
1.836	NOS SGPS SA	8.009	0,02
	<b>Portugal insgesamt</b>	<b>18.149</b>	<b>0,05</b>
<b>Singapur</b>			
2.200	CapitalLand Ltd	4.605	0,01
900	DBS Group Holdings Ltd	13.419	0,04
1.100	Keppel Corp Ltd	4.700	0,01
7.800	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	50.321	0,15
3.000	Singapore Exchange Ltd	17.935	0,06
3.700	Singapore Telecommunications Ltd	6.525	0,02
1.500	United Overseas Bank Ltd	21.752	0,07
1.200	UOL Group Ltd	5.841	0,02
	<b>Singapur insgesamt</b>	<b>125.098</b>	<b>0,38</b>
<b>Spanien</b>			
136	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	3.428	0,01
32	Aena SME SA '144A'	4.266	0,01
352	Amadeus IT Group SA	18.337	0,06
4.676	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	16.092	0,05
11.246	Banco Santander SA	27.466	0,08
1.404	CaixaBank SA	2.997	0,01
350	Cellnex Telecom SA '144A'	21.322	0,07
235	Endesa SA	5.788	0,02
252	Ferrovial SA	6.708	0,02
194	Grifols SA	5.890	0,02
694	Grifols SA - Preference	12.752	0,04
4.231	Iberdrola SA	49.042	0,15

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien (Fortsetzung)</b>			
722	Industria de Diseno Textil SA	19.114	0,06
625	International Consolidated Airlines Group SA	1.716	0,01
5.351	Mapfre SA	9.520	0,03
201	Naturgy Energy Group SA	3.740	0,01
240	Red Electrica Corp SA	4.476	0,01
1.264	Repsol SA	11.054	0,03
3.760	Telefonica SA	17.936	0,06
	<b>Spanien insgesamt</b>	<b>241.644</b>	<b>0,75</b>
<b>Schweden</b>			
200	Alfa Laval AB	4.388	0,01
380	Assa Abloy AB	7.727	0,02
212	Atlas Copco AB	7.841	0,02
616	Atlas Copco AB	26.090	0,08
436	Boliden AB	9.921	0,03
231	Electrolux AB	3.863	0,01
603	Epiroc AB	7.375	0,02
1.165	EQT AB	20.901	0,06
232	Essity AB	7.498	0,02
322	Hennes & Mauritz AB	4.666	0,01
104	Hexagon AB	6.073	0,02
1.162	Industrivarden AB	26.329	0,08
154	Industrivarden AB - Class A	3.494	0,01
685	Investor AB	35.821	0,11
152	Investor AB	8.022	0,02
188	Kinnevik AB	4.946	0,02
478	Sandvik AB	8.932	0,03
701	Skandinaviska Enskilda Banken AB	6.072	0,02
315	Skanska AB	6.407	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (Fortsetzung)</b>			
307	SKF AB	5.706	0,02
3.156	SSAB AB - Class A	8.689	0,03
542	Svenska Cellulosa AB SCA - Class B	6.446	0,02
581	Svenska Handelsbanken AB	5.515	0,02
845	Swedbank AB	10.829	0,03
97	Swedish Match AB	6.820	0,02
2.390	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	22.103	0,07
1.076	Telia Co AB	4.019	0,01
780	Volvo AB	12.215	0,04
694	Volvo AB	10.667	0,03
<b>Schweden insgesamt</b>		<b>299.375</b>	<b>0,90</b>
<b>Schweiz</b>			
1.614	ABB Ltd	36.332	0,11
524	Alcon Inc	30.061	0,09
257	Chubb Ltd	32.541	0,10
434	Cie Financiere Richemont SA	27.683	0,09
2.225	Credit Suisse Group AG	23.007	0,07
77	Garmin Ltd	7.507	0,02
14	Geberit AG	7.006	0,02
7	Givaudan SA	26.063	0,08
37	Kuehne + Nagel International AG	6.146	0,02
178	LafargeHolcim Ltd	7.798	0,02
69	Lonza Group AG	36.424	0,11
2.351	Nestle SA	259.873	0,80
1.816	Novartis AG	157.959	0,49
8	Partners Group Holding AG	7.256	0,02
150	Roche Holding AG	51.448	0,16
457	Roche Holding AG	158.361	0,49

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz (Fortsetzung)</b>			
37	Schindler Holding AG	8.715	0,03
25	Schindler Holding AG	5.884	0,02
2	SGS SA	4.886	0,02
141	Sika AG	27.134	0,08
15	Swatch Group AG/The	2.993	0,01
276	Swiss Re AG	21.281	0,07
11	Swisscom AG	5.757	0,02
279	TE Connectivity Ltd	22.752	0,07
2.879	UBS Group AG	33.133	0,10
97	Zurich Insurance Group AG	34.212	0,11
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>1.042.212</b>	<b>3,22</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
446	3i Group Plc	4.588	0,01
484	Admiral Group Plc	13.749	0,04
267	Amarin Corp Plc ADR	1.848	0,01
1.042	Anglo American Plc	24.068	0,07
205	Ashtead Group Plc	6.887	0,02
161	Associated British Foods Plc	3.810	0,01
1.157	AstraZeneca Plc	120.386	0,37
67	Atlassian Corp Plc	12.078	0,04
1.775	Auto Trader Group Plc '144A'	11.545	0,04
3.556	Aviva Plc	12.021	0,04
2.777	BAE Systems Plc	16.587	0,05
24.030	Barclays Plc	33.973	0,10
715	Barratt Developments Plc	4.381	0,01
150	Berkeley Group Holdings Plc	7.719	0,02
1.645	BHP Group Plc	33.627	0,10
18.914	BP Plc	71.793	0,22



## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
1.976	British American Tobacco Plc	75.798	0,23
637	British Land Co Plc/The (REIT)	3.041	0,01
6.391	BT Group Plc	9.006	0,03
171	Bunzl Plc	4.576	0,01
213	Burberry Group Plc	4.210	0,01
90	Carnival Plc	1.096	0,00
108	Coca-Cola European Partners Plc	4.078	0,01
1.158	Compass Group Plc	15.911	0,05
78	Croda International Plc	5.066	0,02
2.722	Diageo Plc	90.187	0,28
4.112	Direct Line Insurance Group Plc	13.769	0,04
4.865	GlaxoSmithKline Plc	98.379	0,30
647	Halma Plc	18.411	0,06
541	Hargreaves Lansdown Plc	10.886	0,03
16.197	HSBC Holdings Plc	75.769	0,23
750	Imperial Brands Plc	14.257	0,04
545	Informa Plc	3.168	0,01
89	InterContinental Hotels Group Plc	3.923	0,01
82	Intertek Group Plc	5.512	0,02
2.481	ITV Plc	2.289	0,01
1.226	J Sainsbury Plc	3.161	0,01
128	Johnson Matthey Plc	3.318	0,01
1.509	Kingfisher Plc	4.117	0,01
448	Land Securities Group Plc (REIT)	3.061	0,01
5.418	Legal & General Group Plc	14.788	0,05
264	Liberty Global Plc	5.679	0,02
49.277	Lloyds Banking Group Plc	18.981	0,06
272	London Stock Exchange Group Plc	28.090	0,09
1.854	M&G Plc	3.838	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
1.290	Marks & Spencer Group Plc	1.578	0,00
2.233	Melrose Industries Plc	3.145	0,01
210	Mondi Plc	3.919	0,01
2.573	National Grid Plc	31.449	0,10
73	Next Plc	4.414	0,01
159	NMC Health Plc*	1.844	0,01
512	Ocado Group Plc	12.830	0,04
423	Pearson Plc	3.009	0,01
162	Persimmon Plc	4.576	0,01
1.854	Prudential Plc	27.913	0,09
492	Reckitt Benckiser Group Plc	45.180	0,14
1.372	RELX Plc	31.701	0,10
1.251	Rentokil Initial Plc	7.877	0,02
784	Rio Tinto Plc	44.067	0,14
1.669	Rolls-Royce Holdings Plc	5.886	0,02
1.692	Royal Bank of Scotland Group Plc	2.542	0,01
5.229	Royal Dutch Shell Plc	83.152	0,26
1.168	Royal Dutch Shell Plc	17.665	0,05
4.490	RSA Insurance Group Plc	22.735	0,07
692	Sage Group Plc/The	5.744	0,02
146	Schroders Plc	5.320	0,02
624	Segro Plc (REIT)	6.901	0,02
473	Severn Trent Plc	14.488	0,04
316	Smith & Nephew Plc	5.878	0,02
285	Smiths Group Plc	4.972	0,02
82	Spirax-Sarco Engineering Plc	10.108	0,03
1.064	SSE Plc	17.939	0,06
378	St James's Place Plc	4.450	0,01
2.903	Standard Chartered Plc	15.786	0,05

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
1.420	Standard Life Aberdeen Plc	4.695	0,01
2.325	Taylor Wimpey Plc	4.097	0,01
187	TechnipFMC Plc	1.279	0,00
7.325	Tesco Plc	20.645	0,06
702	Unilever Plc	37.775	0,12
517	United Utilities Group Plc	5.814	0,02
18.340	Vodafone Group Plc	29.201	0,09
554	Weir Group Plc/The	7.280	0,02
94	Whitbread Plc	2.581	0,01
1.509	Wm Morrison Supermarkets Plc	3.553	0,01
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>1.487.413</b>	<b>4,56</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>			
412	3M Co	64.268	0,20
303	A O Smith Corp	14.277	0,04
1.299	Abbott Laboratories	118.768	0,36
1.125	AbbVie Inc	110.452	0,34
44	ABIOMED Inc	10.629	0,03
511	Activision Blizzard Inc	38.785	0,12
432	Adobe Inc	188.054	0,58
30	Advance Auto Parts Inc	4.273	0,01
1.096	Advanced Micro Devices Inc	57.661	0,18
489	Aflac Inc	17.619	0,05
274	Agilent Technologies Inc	24.213	0,07
166	Air Products & Chemicals Inc	40.082	0,12
73	Akamai Technologies Inc	7.818	0,02
47	Albemarle Corp	3.629	0,01
159	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	25.798	0,08
175	Alexion Pharmaceuticals Inc	19.642	0,06

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
66	Align Technology Inc	18.113	0,06
8	Alleghany Corp	3.913	0,01
116	Alliant Energy Corp	5.549	0,02
220	Allstate Corp/The	21.338	0,07
196	Ally Financial Inc	3.887	0,01
312	Alphabet Inc	441.046	1,35
181	Alphabet Inc - Class A	256.667	0,79
297	Altice USA Inc	6.694	0,02
1.535	Altria Group Inc	60.249	0,19
343	Amazon.com Inc	946.275	2,91
267	Ameren Corp	18.786	0,06
321	American Electric Power Co Inc	25.564	0,08
475	American Express Co	45.220	0,14
49	American Financial Group Inc/OH	3.110	0,01
598	American International Group Inc	18.646	0,06
395	American Tower Corp (REIT)	102.123	0,31
289	American Water Works Co Inc	37.183	0,11
155	Ameriprise Financial Inc	23.256	0,07
63	AmerisourceBergen Corp - Class A	6.349	0,02
93	AMETEK Inc	8.311	0,03
514	Amgen Inc	121.232	0,37
236	Amphenol Corp - Class A	22.611	0,07
274	Analog Devices Inc	33.603	0,10
509	Annaly Capital Management Inc (REIT)	3.339	0,01
33	ANSYS Inc	9.627	0,03
237	Anthem Inc	62.326	0,19
202	Apollo Global Management Inc - Class A	10.084	0,03
3.566	Apple Inc	1.300.877	4,00
721	Applied Materials Inc	43.584	0,13

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
411	Archer-Daniels-Midland Co	16.399	0,05
66	Arista Networks Inc	13.862	0,04
71	Arthur J Gallagher & Co	6.922	0,02
5.796	AT&T Inc	175.213	0,54
54	Atmos Energy Corp	5.377	0,02
173	Autodesk Inc	41.380	0,13
417	Automatic Data Processing Inc	62.087	0,19
20	AutoZone Inc	22.562	0,07
110	AvalonBay Communities Inc (REIT)	17.010	0,05
245	Avangrid Inc	10.285	0,03
186	Baker Hughes Co - Class A	2.863	0,01
424	Ball Corp	29.464	0,09
6.560	Bank of America Corp	155.800	0,48
561	Bank of New York Mellon Corp/The	21.683	0,07
340	Baxter International Inc	29.274	0,09
241	Becton Dickinson and Co	57.664	0,18
1.003	Berkshire Hathaway Inc - Class B	179.046	0,55
88	Best Buy Co Inc	7.680	0,02
141	Biogen Inc	37.725	0,12
282	BioMarin Pharmaceutical Inc	34.782	0,11
75	BlackRock Inc	40.807	0,13
500	Blackstone Group Inc/The	28.330	0,09
441	Boeing Co/The	80.835	0,25
33	Booking Holdings Inc	52.547	0,16
154	Boston Properties Inc (REIT)	13.919	0,04
1.046	Boston Scientific Corp	36.725	0,11
1.987	Bristol-Myers Squibb Co	116.836	0,36
343	Broadcom Inc	108.254	0,33
43	Broadridge Financial Solutions Inc	5.426	0,02

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
162	Brown-Forman Corp	10.313	0,03
210	Brown-Forman Corp	12.090	0,04
192	Cabot Oil & Gas Corp	3.299	0,01
111	Cadence Design Systems Inc	10.652	0,03
133	Campbell Soup Co	6.601	0,02
368	Capital One Financial Corp	23.033	0,07
111	Cardinal Health Inc	5.793	0,02
71	CarMax Inc	6.358	0,02
405	Caterpillar Inc	51.232	0,16
45	Cboe Global Markets Inc	4.198	0,01
550	CBRE Group Inc - Class A	24.871	0,08
64	CDW Corp/DE	7.436	0,02
49	Celanese Corp - Class A	4.231	0,01
416	Centene Corp	26.437	0,08
182	CenterPoint Energy Inc	3.398	0,01
1.099	CenturyLink Inc	11.023	0,03
295	Cerner Corp	20.222	0,06
57	CH Robinson Worldwide Inc	4.506	0,01
797	Charles Schwab Corp/The	26.891	0,08
121	Charter Communications Inc	61.715	0,19
92	Cheniere Energy Inc	4.445	0,01
1.558	Chevron Corp	139.020	0,43
31	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	32.623	0,10
100	Church & Dwight Co Inc	7.730	0,02
257	Cigna Corp	48.226	0,15
63	Cincinnati Financial Corp	4.034	0,01
104	Cintas Corp	27.701	0,09
3.289	Cisco Systems Inc	153.399	0,47
1.634	Citigroup Inc	83.497	0,26

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
182	Citizens Financial Group Inc	4.594	0,01
153	Citrix Systems Inc	22.630	0,07
133	Clorox Co/The	29.176	0,09
335	CME Group Inc	54.451	0,17
106	CMS Energy Corp	6.193	0,02
3.070	Coca-Cola Co/The	137.168	0,42
394	Cognizant Technology Solutions Corp	22.387	0,07
564	Colgate-Palmolive Co	41.319	0,13
3.955	Comcast Corp	154.166	0,47
505	Conagra Brands Inc	17.761	0,05
178	Concho Resources Inc	9.167	0,03
810	ConocoPhillips	34.036	0,10
268	Consolidated Edison Inc	19.277	0,06
126	Constellation Brands Inc - Class A	22.044	0,07
20	Cooper Cos Inc/The	5.673	0,02
217	Copart Inc	18.070	0,06
617	Corning Inc	15.980	0,05
494	Corteva Inc	13.234	0,04
32	CoStar Group Inc	22.741	0,07
371	Costco Wholesale Corp	112.491	0,35
279	Crown Castle International Corp (REIT)	46.691	0,14
511	CSX Corp	35.637	0,11
141	Cummins Inc	24.430	0,08
1.200	CVS Health Corp	77.964	0,24
467	Danaher Corp	82.580	0,25
47	Darden Restaurants Inc	3.561	0,01
73	DaVita Inc	5.777	0,02
233	Deere & Co	36.616	0,11
204	Dell Technologies Inc	11.208	0,03

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
505	Delta Air Lines Inc	14.165	0,04
143	DENTSPLY SIRONA Inc	6.301	0,02
95	DexCom Inc	38.513	0,12
167	Digital Realty Trust Inc (REIT)	23.732	0,07
325	Discover Financial Services	16.279	0,05
559	Discovery Inc	11.795	0,04
161	DISH Network Corp - Class A	5.556	0,02
198	DocuSign Inc - Class A	34.098	0,10
205	Dollar General Corp	39.055	0,12
174	Dollar Tree Inc	16.126	0,05
648	Dominion Energy Inc	52.605	0,16
19	Domino's Pizza Inc	7.019	0,02
59	Dover Corp	5.697	0,02
569	Dow Inc	23.192	0,07
629	DR Horton Inc	34.878	0,11
72	DTE Energy Co	7.740	0,02
718	Duke Energy Corp	57.361	0,18
179	Duke Realty Corp (REIT)	6.335	0,02
494	DuPont de Nemours Inc	26.246	0,08
100	E*TRADE Financial Corp	4.973	0,02
147	Eastman Chemical Co	10.237	0,03
730	eBay Inc	38.288	0,12
168	Ecolab Inc	33.424	0,10
260	Edison International	14.121	0,04
459	Edwards Lifesciences Corp	31.721	0,10
532	Elanco Animal Health Inc	11.411	0,04
229	Electronic Arts Inc	30.239	0,09
622	Eli Lilly and Co	102.120	0,31
460	Emerson Electric Co	28.534	0,09



## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
67	Entergy Corp	6.285	0,02
423	EOG Resources Inc	21.429	0,07
48	Equifax Inc	8.250	0,03
63	Equinix Inc (REIT)	44.245	0,14
289	Equity Residential (REIT)	16.999	0,05
23	Essex Property Trust Inc (REIT)	5.271	0,02
165	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	31.132	0,10
102	Evergy Inc	6.048	0,02
259	Eversource Energy	21.567	0,07
972	Exelon Corp	35.274	0,11
202	Expedia Group Inc	16.604	0,05
74	Expeditors International of Washington Inc	5.627	0,02
56	Extra Space Storage Inc (REIT)	5.173	0,02
3.664	Exxon Mobil Corp	163.854	0,50
28	F5 Networks Inc	3.905	0,01
2.004	Facebook Inc - Class A	455.048	1,40
218	Fastenal Co	9.339	0,03
295	Federal Realty Investment Trust (REIT)	25.137	0,08
172	FedEx Corp	24.118	0,07
152	Fidelity National Financial Inc	4.660	0,01
617	Fidelity National Information Services Inc	82.734	0,25
1.121	Fifth Third Bancorp	21.613	0,07
66	First Republic Bank/CA	6.995	0,02
481	FirstEnergy Corp	18.653	0,06
411	Fiserv Inc	40.122	0,12
92	FleetCor Technologies Inc	23.141	0,07
62	FMC Corp	6.176	0,02
2.759	Ford Motor Co	16.775	0,05
67	Fortinet Inc	9.197	0,03

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
255	Fortive Corp	17.253	0,05
377	Fortune Brands Home & Security Inc	24.102	0,07
140	Fox Corp	3.755	0,01
255	Fox Corp	6.844	0,02
162	Franklin Resources Inc	3.397	0,01
36	Gartner Inc	4.368	0,01
178	General Dynamics Corp	26.604	0,08
6.637	General Electric Co	45.331	0,14
426	General Mills Inc	26.263	0,08
838	General Motors Co	21.201	0,07
51	Genuine Parts Co	4.435	0,01
1.097	Gilead Sciences Inc	84.403	0,26
317	Global Payments Inc	53.770	0,17
58	Globe Life Inc	4.305	0,01
226	Goldman Sachs Group Inc/The	44.662	0,14
1.550	Halliburton Co	20.119	0,06
560	Hartford Financial Services Group Inc/The	21.588	0,07
51	Hasbro Inc	3.822	0,01
210	HCA Healthcare Inc	20.383	0,06
188	Healthpeak Properties Inc (REIT)	5.181	0,02
59	Henry Schein Inc	3.445	0,01
189	Hershey Co/The	24.498	0,08
111	Hess Corp	5.751	0,02
1.207	Hewlett Packard Enterprise Co	11.744	0,04
298	Hilton Worldwide Holdings Inc	21.888	0,07
125	Hologic Inc	7.125	0,02
843	Home Depot Inc/The	211.180	0,65
572	Honeywell International Inc	82.705	0,25
113	Hormel Foods Corp	5.455	0,02

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
262	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	2.827	0,01
1.221	HP Inc	21.282	0,07
105	Humana Inc	40.714	0,13
404	Huntington Bancshares Inc/OH	3.650	0,01
22	Huntington Ingalls Industries Inc	3.839	0,01
65	IAC/interactivecorp	21.021	0,06
91	IDEXX Laboratories Inc	30.045	0,09
202	Illinois Tool Works Inc	35.320	0,11
111	Illumina Inc	41.109	0,13
73	Incyte Corp	7.590	0,02
172	Ingersoll Rand Inc	4.837	0,01
3.392	Intel Corp	202.943	0,62
563	Intercontinental Exchange Inc	51.571	0,16
783	International Business Machines Corp	94.563	0,29
42	International Flavors & Fragrances Inc	5.143	0,02
359	International Paper Co	12.640	0,04
216	Interpublic Group of Cos Inc/The	3.707	0,01
185	Intuit Inc	54.795	0,17
82	Intuitive Surgical Inc	46.726	0,14
606	Invitation Homes Inc (REIT)	16.683	0,05
162	IQVIA Holdings Inc	22.985	0,07
158	Iron Mountain Inc (REIT)	4.124	0,01
46	J M Smucker Co/The	4.867	0,01
46	JB Hunt Transport Services Inc	5.536	0,02
2.540	JPMorgan Chase & Co	238.912	0,73
168	Juniper Networks Inc	3.840	0,01
49	Kansas City Southern	7.315	0,02
106	Kellogg Co	7.002	0,02
452	Keurig Dr Pepper Inc	12.837	0,04

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
1.082	KeyCorp	13.179	0,04
187	Keysight Technologies Inc	18.846	0,06
264	Kimberly-Clark Corp	37.316	0,11
1.433	Kinder Morgan Inc	21.739	0,07
208	KKR & Co Inc	6.423	0,02
183	KLA Corp	35.590	0,11
343	Kraft Heinz Co/The	10.938	0,03
596	Kroger Co/The	20.175	0,06
144	L3Harris Technologies Inc	24.432	0,08
39	Laboratory Corp of America Holdings	6.478	0,02
115	Lam Research Corp	37.198	0,11
321	Las Vegas Sands Corp	14.618	0,04
80	Leidos Holdings Inc	7.494	0,02
28	Lennar Corp	1.725	0,01
370	Lennar Corp	17.053	0,05
60	Liberty Broadband Corp	7.438	0,02
109	Liberty Broadband Corp	13.319	0,04
123	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	4.237	0,01
82	Lincoln National Corp	3.017	0,01
180	LKQ Corp	4.716	0,01
211	Lockheed Martin Corp	76.998	0,24
103	Loews Corp	3.532	0,01
525	Lowe's Cos Inc	70.938	0,22
105	Lululemon Athletica Inc	32.761	0,10
186	Lyft Inc	6.140	0,02
106	M&T Bank Corp	11.021	0,03
501	Marathon Petroleum Corp	18.727	0,06
5	Markel Corp	4.616	0,01
211	Marriott International Inc/MD	18.089	0,06

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
520	Marsh & McLennan Cos Inc	55.832	0,17
29	Martin Marietta Materials Inc	5.991	0,02
159	Masco Corp	7.983	0,02
707	Mastercard Inc	209.060	0,64
311	Maxim Integrated Products Inc	18.850	0,06
164	McCormick & Co Inc/MD	29.423	0,09
707	McDonald's Corp	130.420	0,40
149	McKesson Corp	22.860	0,07
36	MercadoLibre Inc	35.488	0,11
2.170	Merck & Co Inc	167.806	0,52
498	MetLife Inc	18.187	0,06
10	Mettler-Toledo International Inc	8.055	0,02
572	MGM Resorts International	9.610	0,03
200	Microchip Technology Inc	21.062	0,06
817	Micron Technology Inc	42.092	0,13
6.144	Microsoft Corp	1.250.365	3,84
51	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	5.848	0,02
39	Mohawk Industries Inc	3.969	0,01
79	Molson Coors Beverage Co - Class B	2.714	0,01
1.293	Mondelez International Inc	66.111	0,20
353	Monster Beverage Corp	24.470	0,08
136	Moody's Corp	37.363	0,11
936	Morgan Stanley	45.209	0,14
187	Motorola Solutions Inc	26.204	0,08
94	MSCI Inc - Class A	31.379	0,10
56	Nasdaq Inc	6.690	0,02
106	NetApp Inc	4.703	0,01
363	Netflix Inc	165.180	0,51
250	Newell Brands Inc	3.970	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
831	Newmont Corp	51.306	0,16
438	NextEra Energy Inc	105.194	0,32
1.034	NIKE Inc	101.384	0,31
193	NiSource Inc	4.389	0,01
185	Norfolk Southern Corp	32.480	0,10
196	Northern Trust Corp	15.551	0,05
119	Northrop Grumman Corp	36.585	0,11
250	NortonLifeLock Inc	4.957	0,02
296	Nucor Corp	12.257	0,04
518	NVIDIA Corp	196.793	0,60
2	NVR Inc	6.517	0,02
682	Occidental Petroleum Corp	12.481	0,04
137	Okta Inc	27.432	0,08
128	Old Dominion Freight Line Inc	21.708	0,07
224	Omnicom Group Inc	12.230	0,04
368	ONEOK Inc	12.225	0,04
1.640	Oracle Corp	90.643	0,28
62	O'Reilly Automotive Inc	26.144	0,08
137	PACCAR Inc	10.254	0,03
52	Packaging Corp of America	5.190	0,02
80	Palo Alto Networks Inc	18.374	0,06
132	Parker-Hannifin Corp	24.192	0,07
197	Paychex Inc	14.923	0,05
1.020	PayPal Holdings Inc	177.715	0,55
1.100	PepsiCo Inc	145.486	0,45
4.228	Pfizer Inc	138.256	0,42
1.296	Philip Morris International Inc	90.798	0,28
320	Phillips 66	23.008	0,07
60	Pinnacle West Capital Corp	4.397	0,01

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
162	Pioneer Natural Resources Co	15.827	0,05
283	PNC Financial Services Group Inc/The	29.774	0,09
182	PPG Industries Inc	19.303	0,06
569	PPL Corp	14.703	0,05
106	Principal Financial Group Inc	4.403	0,01
1.957	Procter & Gamble Co/The	233.998	0,72
416	Progressive Corp/The	33.326	0,10
770	Prologis Inc (REIT)	71.864	0,22
279	Prudential Financial Inc	16.991	0,05
364	Public Service Enterprise Group Inc	17.894	0,05
101	Public Storage (REIT)	19.381	0,06
202	PulteGroup Inc	6.874	0,02
72	Qorvo Inc	7.958	0,02
968	QUALCOMM Inc	88.291	0,27
53	Quest Diagnostics Inc	6.040	0,02
63	Raymond James Financial Inc	4.336	0,01
1.394	Raytheon Technologies Corp	85.898	0,26
284	Realty Income Corp (REIT)	16.898	0,05
79	Regency Centers Corp (REIT)	3.625	0,01
59	Regeneron Pharmaceuticals Inc	36.795	0,11
1.244	Regions Financial Corp	13.833	0,04
35	Reinsurance Group of America Inc	2.745	0,01
87	Republic Services Inc - Class A	7.138	0,02
180	ResMed Inc	34.560	0,11
77	RingCentral Inc - Class A	21.946	0,07
125	Rockwell Automation Inc	26.625	0,08
357	Rollins Inc	15.133	0,05
81	Roper Technologies Inc	31.449	0,10
267	Ross Stores Inc	22.759	0,07

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
178	S&P Global Inc	58.647	0,18
705	salesforce.com Inc	132.068	0,41
142	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	42.305	0,13
87	Seattle Genetics Inc	14.783	0,05
93	SEI Investments Co	5.113	0,02
198	Sempra Energy	23.212	0,07
145	ServiceNow Inc	58.734	0,18
65	Sherwin-Williams Co/The	37.560	0,12
208	Simon Property Group Inc (REIT)	14.223	0,04
818	Sirius XM Holdings Inc	4.802	0,01
75	Skyworks Solutions Inc	9.589	0,03
769	Snap Inc	18.064	0,06
32	Snap-on Inc	4.432	0,01
1.075	Southern Co/The (Units)	55.739	0,17
361	Southwest Airlines Co	12.339	0,04
160	Splunk Inc	31.792	0,10
227	Square Inc	23.821	0,07
344	SS&C Technologies Holdings Inc	19.429	0,06
127	Stanley Black & Decker Inc	17.701	0,05
865	Starbucks Corp	63.655	0,20
263	State Street Corp	16.714	0,05
319	Stryker Corp	57.481	0,18
21	SVB Financial Group	4.526	0,01
647	Synchrony Financial	14.338	0,04
201	Synopsys Inc	39.195	0,12
325	Sysco Corp	17.764	0,05
222	T Rowe Price Group Inc	27.417	0,08
44	Take-Two Interactive Software Inc	6.141	0,02
404	Target Corp	48.452	0,15



## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
121	TD Ameritrade Holding Corp	4.402	0,01
19	Teleflex Inc	6.916	0,02
111	Tesla Inc	119.859	0,37
885	Texas Instruments Inc	112.368	0,35
91	Textron Inc	2.995	0,01
377	Thermo Fisher Scientific Inc	136.602	0,42
44	Tiffany & Co	5.365	0,02
781	TJX Cos Inc/The	39.487	0,12
287	T-Mobile US Inc	29.891	0,09
53	Tractor Supply Co	6.985	0,02
49	TransDigm Group Inc	21.660	0,07
223	TransUnion	19.410	0,06
185	Travelers Cos Inc/The	21.099	0,06
138	Trimble Inc	5.960	0,02
1.003	Truist Financial Corp	37.663	0,12
82	Twilio Inc - Class A	17.992	0,06
526	Twitter Inc	15.670	0,05
241	Tyson Foods Inc - Class A	14.390	0,04
647	Uber Technologies Inc	20.109	0,06
126	UDR Inc (REIT)	4.710	0,01
92	UGI Corp	2.926	0,01
60	Ulta Beauty Inc	12.205	0,04
545	Union Pacific Corp	92.143	0,28
218	United Airlines Holdings Inc	7.545	0,02
563	United Parcel Service Inc - Class B	62.594	0,19
39	United Rentals Inc	5.813	0,02
794	UnitedHealth Group Inc	234.190	0,72
40	Universal Health Services Inc	3.716	0,01
1.381	US Bancorp	50.848	0,16

## L&amp;G Global Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
20	Vail Resorts Inc	3.643	0,01
307	Valero Energy Corp	18.058	0,06
41	Varian Medical Systems Inc	5.023	0,02
139	Veeva Systems Inc - Class A	32.584	0,10
269	Ventas Inc (REIT)	9.851	0,03
43	VeriSign Inc	8.894	0,03
167	Verisk Analytics Inc - Class A	28.423	0,09
3.424	Verizon Communications Inc	188.765	0,58
190	Vertex Pharmaceuticals Inc	55.159	0,17
230	VF Corp	14.016	0,04
454	ViacomCBS Inc - Class B	10.587	0,03
1.402	Visa Inc - Class A	270.824	0,83
35	VMware Inc	5.420	0,02
74	Vornado Realty Trust (REIT)	2.828	0,01
52	Vulcan Materials Co	6.024	0,02
97	W R Berkley Corp	5.557	0,02
740	Walgreens Boots Alliance Inc	31.369	0,10
1.158	Walmart Inc	138.705	0,43
1.455	Walt Disney Co/The	162.247	0,50
261	Waste Management Inc	27.643	0,08
30	Waters Corp	5.412	0,02
252	WEC Energy Group Inc	22.088	0,07
270	Welltower Inc (REIT)	13.972	0,04
255	Western Digital Corp	11.258	0,03
271	Western Union Co/The	5.859	0,02
89	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	5.124	0,02
110	Westrock Co	3.109	0,01
651	Weyerhaeuser Co (REIT)	14.621	0,04
43	Whirlpool Corp	5.570	0,02

## L&G Global Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,74 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
929	Williams Cos Inc/The	17.670	0,05
114	Workday Inc - Class A	21.359	0,07
215	WP Carey Inc (REIT)	14.545	0,04
18	WW Grainger Inc	5.655	0,02
159	Wynn Resorts Ltd	11.844	0,04
401	Xcel Energy Inc	25.062	0,08
177	Xilinx Inc	17.415	0,05
73	Xylem Inc/NY	4.742	0,01
154	Yum China Holdings Inc	7.403	0,02
273	Yum! Brands Inc	23.726	0,07
176	Zimmer Biomet Holdings Inc	21.007	0,06
401	Zoetis Inc	54.953	0,17
98	Zoom Video Communications Inc	24.847	0,08
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>20.116.708</b>	<b>61,78</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>32.474.303</b>	<b>99,76</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		32.474.303	99,76
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		77.776	0,24
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>32.552.079</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,75
Sonstige Vermögenswerte			0,25
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

\* Der Handel dieses Wertpapiers wurde ausgesetzt.

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %)</b>			
<b>Österreich</b>			
5.015	ams AG	66.229	0,07
1.254	ANDRITZ AG	40.630	0,04
1.477	BAWAG Group AG '144A'	45.403	0,05
1.144	CA Immobilien Anlagen AG	33.920	0,03
5.789	Erste Group Bank AG	121.280	0,12
266	Mayr Melnhof Karton AG	36.495	0,04
858	Oesterreichische Post AG	25.268	0,03
2.646	OMV AG	78.745	0,08
2.508	Raiffeisen Bank International AG	39.777	0,04
1.677	Telekom Austria AG - Class A	10.314	0,01
1.738	Verbund AG	69.277	0,07
828	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	16.477	0,02
2.071	voestalpine AG	39.649	0,04
	<b>Österreich insgesamt</b>	<b>623.464</b>	<b>0,64</b>
<b>Belgien</b>			
402	Ackermans & van Haaren NV	46.793	0,05
3.332	Ageas SA/NV	105.091	0,11
15.903	Anheuser-Busch InBev SA/NV	697.585	0,70
822	Colruyt SA	40.253	0,04
408	Elia Group SA/NV	39.413	0,04
778	Galapagos NV	136.189	0,14
1.423	Groupe Bruxelles Lambert SA	106.270	0,11
5.735	KBC Group NV	292.829	0,29
2.614	Proximus SADP	47.418	0,05
273	Sofina SA	64.155	0,06
1.241	Solvay SA	88.434	0,09
887	Telenet Group Holding NV	32.500	0,03
2.287	UCB SA	235.790	0,24

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Belgien (Fortsetzung)</b>			
3.344	Umicore SA	140.147	0,14
2.975	Warehouses De Pauw CVA (REIT)	72.292	0,07
	<b>Belgien insgesamt</b>	<b>2.145.159</b>	<b>2,16</b>
<b>Bermuda</b>			
1.427	HAL Trust	180.373	0,18
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>180.373</b>	<b>0,18</b>
<b>Dänemark</b>			
42	AP Moller - Maersk A/S - Class A	40.573	0,04
119	AP Moller - Maersk A/S - Class B	123.386	0,12
1.758	Carlsberg AS	206.763	0,21
1.800	Chr Hansen Holding A/S	165.189	0,17
2.192	Coloplast A/S	302.334	0,30
10.509	Danske Bank A/S	124.473	0,12
1.894	Demant A/S	44.445	0,04
4.099	DSV PANALPINA A/S	445.357	0,45
1.125	Genmab A/S	335.087	0,34
1.130	H Lundbeck A/S	37.812	0,04
31.056	Novo Nordisk A/S	1.789.206	1,79
3.767	Novozymes A/S	193.827	0,19
3.254	Orsted A/S '144A'	334.163	0,33
2.152	Tryg A/S	55.437	0,06
3.823	Vestas Wind Systems A/S	346.432	0,35
	<b>Dänemark insgesamt</b>	<b>4.544.484</b>	<b>4,55</b>
<b>Färöer Inseln</b>			
733	Bakkafrost P/F	40.962	0,04
	<b>Färöer Inseln insgesamt</b>	<b>40.962</b>	<b>0,04</b>

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Finnland</b>			
2.308	Elisa Oyj	124.955	0,12
9.542	Fortum Oyj	161.307	0,16
1.616	Huhtamaki Oyj	56.625	0,06
4.848	Kesko Oyj	73.787	0,07
6.722	Kone Oyj - Class B	411.521	0,41
2.307	Metso Oyj	67.295	0,07
8.892	Neste Oyj	309.531	0,31
106.740	Nokia Oyj	415.058	0,42
74.457	Nordea Bank Abp	457.762	0,46
1.906	Orion Oyj	82.072	0,08
7.751	Sampo Oyj - Class A	237.336	0,24
10.204	Stora Enso Oyj	108.469	0,11
10.091	UPM-Kymmene Oyj	259.540	0,26
9.747	Wartsila OYJ Abp	71.718	0,07
	<b>Finnland insgesamt</b>	<b>2.836.976</b>	<b>2,84</b>
<b>Frankreich</b>			
2.835	Accor SA	68.635	0,07
607	Aéroports de Paris	55.480	0,06
8.936	Air Liquide SA	1.147.382	1,15
1.128	Amundi SA '144A'	78.622	0,08
40.926	AXA SA	761.715	0,76
708	BioMerieux	86.588	0,09
21.256	BNP Paribas SA	751.825	0,75
16.375	Bolloré SA	45.784	0,05
5.323	Bouygues SA	161.872	0,16
2.782	Capgemini SE	283.625	0,28
10.532	Carrefour SA	144.868	0,14
9.136	Cie de Saint-Gobain	292.809	0,29

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (Fortsetzung)</b>			
2.967	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	273.973	0,27
21.676	Credit Agricole SA	182.685	0,18
11.622	Danone SA	715.450	0,72
2.569	Dassault Systemes SE	394.598	0,39
16.230	Electricite de France SA	133.248	0,13
33.238	Engie SA	365.618	0,37
5.669	EssilorLuxottica SA	647.683	0,65
584	Hermes International	434.379	0,43
1.446	Kering SA	700.225	0,70
4.784	Legrand SA	323.494	0,32
4.508	L'Oreal SA	1.287.936	1,29
4.879	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1.905.249	1,91
17.208	Natixis SA	40.009	0,04
37.216	Orange SA	396.164	0,40
3.083	Pernod Ricard SA	431.774	0,43
9.557	Peugeot SA	138.385	0,14
3.822	Publicis Groupe SA	110.112	0,11
6.431	Safran SA	573.774	0,57
19.979	Sanofi	1.811.096	1,81
448	Sartorius Stedim Biotech	100.800	0,10
10.729	Schneider Electric SE	1.060.884	1,06
13.636	Societe Generale SA	201.813	0,20
1.531	Sodexo SA	92.166	0,09
1.069	Teleperformance	241.487	0,24
1.788	Thales SA	128.521	0,13
47.442	TOTAL SA	1.611.842	1,61
2.436	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	122.190	0,12

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (Fortsetzung)</b>			
10.188	Vinci SA	835.416	0,84
13.365	Vivendi SA	305.257	0,31
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>19.445.433</b>	<b>19,44</b>
<b>Deutschland</b>			
3.293	adidas AG	769.245	0,77
7.626	Allianz SE	1.386.102	1,39
16.809	BASF SE	838.433	0,84
18.346	Bayer AG	1.206.983	1,21
9.239	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	398.940	0,40
1.628	Beiersdorf AG	164.591	0,16
1.847	Continental AG	160.985	0,16
2.832	Covestro AG '144A'	95.863	0,10
15.170	Daimler AG	548.320	0,55
2.282	Delivery Hero SE '144A'	207.571	0,21
30.996	Deutsche Bank AG	262.350	0,26
3.561	Deutsche Boerse AG	573.499	0,57
18.909	Deutsche Post AG	615.488	0,62
63.603	Deutsche Telekom AG	950.547	0,95
6.201	Deutsche Wohnen SE	247.730	0,25
41.901	E.ON SE	419.639	0,42
3.100	Evonik Industries AG	70.091	0,07
3.610	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	275.443	0,28
7.382	Fresenius SE & Co KGaA	325.694	0,33
1.010	Hannover Rueck SE	154.934	0,16
637	Hapag-Lloyd AG '144A'	33.060	0,03
3.339	HeidelbergCement AG	158.736	0,16
1.900	Henkel AG & Co KGaA	140.885	0,14



## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (Fortsetzung)</b>			
3.041	Henkel AG & Co KGaA - Preference	252.038	0,25
644	HOCHTIEF AG	50.844	0,05
23.947	Infineon Technologies AG	499.894	0,50
739	Knorr-Bremse AG	66.680	0,07
2.234	Merck KGaA	230.772	0,23
1.104	MTU Aero Engines AG	170.182	0,17
2.753	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	637.044	0,64
2.578	Porsche Automobil Holding SE - Preference	131.890	0,13
11.315	RWE AG	352.010	0,35
19.539	SAP SE	2.429.088	2,43
630	Sartorius AG - Preference	184.338	0,18
15.273	Siemens AG	1.599.999	1,60
2.779	Siemens Healthineers AG '144A'	118.524	0,12
2.191	Symrise AG - Class A	226.768	0,23
898	Talanx AG	29.706	0,03
14.089	Telefonica Deutschland Holding AG	37.012	0,04
10.240	Vonovia SE	558.899	0,56
2.839	Zalando SE '144A'	178.232	0,18
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>17.759.049</b>	<b>17,79</b>
<b>Irland</b>			
14.541	AIB Group Plc	16.286	0,02
14.826	CRH Plc	452.193	0,45
1.425	Flutter Entertainment Plc	166.725	0,17
965	ICON Plc	144.737	0,14
7.419	James Hardie Industries Plc CDI	125.158	0,13
2.898	Kerry Group Plc	319.649	0,32
3.183	Kingspan Group Plc	182.545	0,18

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland (Fortsetzung)</b>			
18.056	Ryanair Holdings Plc	192.387	0,19
4.348	Smurfit Kappa Group Plc	129.396	0,13
<b>Irland insgesamt</b>		<b>1.729.076</b>	<b>1,73</b>
<b>Italien</b>			
28.257	A2A SpA	35.618	0,04
2.547	Amplifon SpA	60.389	0,06
24.314	Assicurazioni Generali SpA	327.510	0,33
7.636	Atlantia SpA	109.195	0,11
5.005	Banca Mediolanum SpA	31.982	0,03
1.733	Buzzi Unicem SpA	33.222	0,03
10.530	Davide Campari-Milano SpA	78.975	0,08
538	DiaSorin SpA	91.675	0,09
145.903	Enel SpA	1.120.243	1,12
45.543	Eni SpA	386.660	0,39
10.210	FinecoBank Banca Fineco SpA	122.673	0,12
11.855	Hera SpA	39.667	0,04
3.635	Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A'	32.424	0,03
281.390	Intesa Sanpaolo SpA	479.376	0,48
7.388	Leonardo SpA	43.589	0,04
12.860	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	82.175	0,08
3.277	Moncler SpA	111.549	0,11
4.290	Nexi SpA '144A'	66.066	0,07
7.987	Pirelli & C SpA '144A'	30.151	0,03
8.594	Poste Italiane SpA '144A'	66.518	0,07
9.400	PRADA SpA	29.047	0,03
4.672	Prysmian SpA	96.337	0,10
1.738	Recordati SpA	77.254	0,08

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Italien (Fortsetzung)</b>			
10.432	Saipem SpA	23.149	0,02
33.909	Snam SpA	146.962	0,15
320.241	Telecom Italia SpA/Milano	111.988	0,11
110.680	Telecom Italia SpA/Milano	38.185	0,04
22.925	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	140.255	0,14
42.919	UniCredit SpA	351.421	0,35
12.245	UnipolSai Assicurazioni SpA	26.057	0,03
	<b>Italien insgesamt</b>	<b>4.390.312</b>	<b>4,40</b>
<b>Jersey</b>			
220.040	Glencore Plc	414.465	0,41
	<b>Jersey insgesamt</b>	<b>414.465</b>	<b>0,41</b>
<b>Luxemburg</b>			
9.863	ArcelorMittal SA	92.416	0,09
2.423	Millicom International Cellular SA SDR	56.452	0,06
583	RTL Group SA	16.615	0,02
8.453	Tenaris SA	48.588	0,05
	<b>Luxemburg insgesamt</b>	<b>214.071</b>	<b>0,22</b>
<b>Niederlande</b>			
8.129	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A'	62.317	0,06
341	Adyen NV '144A'	441.765	0,44
3.182	AerCap Holdings NV	87.258	0,09
11.053	Airbus SE	702.087	0,70
3.144	Akzo Nobel NV	250.703	0,25
7.853	ASML Holding NV	2.567.146	2,57
1.732	EXOR NV	88.055	0,09

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Niederlande (Fortsetzung)</b>			
1.966	Ferrari NV	298.537	0,30
1.585	Heineken Holding NV	115.467	0,12
3.722	Heineken NV	305.427	0,31
73.070	ING Groep NV	452.888	0,45
2.383	Just Eat Takeaway.com NV '144A'	221.047	0,22
17.165	Koninklijke Ahold Delhaize NV	416.423	0,42
3.396	Koninklijke DSM NV	418.387	0,42
61.880	Koninklijke KPN NV	146.037	0,15
16.130	Koninklijke Philips NV	669.718	0,67
5.936	NN Group NV	177.486	0,18
5.221	NXP Semiconductors NV	530.109	0,53
7.594	Prosus NV	628.328	0,63
1.842	Randstad NV	73.054	0,07
13.066	STMicroelectronics NV	316.459	0,32
25.570	Unilever NV	1.208.182	1,21
4.732	Wolters Kluwer NV	328.969	0,33
	<b>Niederlande insgesamt</b>	<b>10.505.849</b>	<b>10,53</b>
<b>Norwegen</b>			
4.727	Adevinta ASA	42.274	0,04
414	Aker ASA	13.388	0,01
2.002	Aker BP ASA	32.390	0,03
1.140	Austevoll Seafood ASA	8.359	0,01
16.564	DNB ASA	194.301	0,19
2.218	Entra ASA '144A'	25.138	0,03
21.288	Equinor ASA	268.379	0,27
3.449	Gjensidige Forsikring ASA	56.373	0,06
1.886	Kongsberg Gruppen ASA	23.464	0,02

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Norwegen (Fortsetzung)</b>			
5.116	Leroy Seafood Group ASA	27.272	0,03
8.182	Mowi ASA	137.925	0,14
24.354	Norsk Hydro ASA	59.721	0,06
13.632	Orkla ASA	106.060	0,11
944	Salmar ASA	39.998	0,04
1.016	Schibsted ASA	23.517	0,02
1.444	Schibsted ASA - Class B	30.199	0,03
3.118	SpareBank 1 SR-Bank ASA	20.115	0,02
8.569	Storebrand ASA	39.234	0,04
12.461	Telenor ASA	161.122	0,16
1.876	TGS NOPEC Geophysical Co ASA	24.127	0,02
2.019	TOMRA Systems ASA	65.796	0,07
2.754	Yara International ASA	84.868	0,08
	<b>Norwegen insgesamt</b>	<b>1.484.020</b>	<b>1,48</b>
<b>Portugal</b>			
38.489	EDP - Energias de Portugal SA	163.578	0,16
8.962	Galp Energia SGPS SA	92.264	0,09
3.924	Jeronimo Martins SGPS SA	61.156	0,06
4.246	NOS SGPS SA	16.491	0,02
	<b>Portugal insgesamt</b>	<b>333.489</b>	<b>0,33</b>
<b>Spanien</b>			
4.148	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	93.081	0,09
1.182	Aena SME SA '144A'	140.303	0,14
8.900	Amadeus IT Group SA	412.782	0,41
127.422	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	390.421	0,39
308.869	Banco Santander SA	671.636	0,67

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien (Fortsetzung)</b>			
21.483	Bankia SA	20.374	0,02
56.906	CaixaBank SA	108.150	0,11
4.987	Cellnex Telecom SA '144A'	270.495	0,27
5.808	Endesa SA	127.369	0,13
9.613	Ferrovial SA	227.828	0,23
5.264	Grifols SA	142.286	0,14
6.108	Grifols SA - Preference	99.927	0,10
115.965	Iberdrola SA	1.196.759	1,20
21.219	Industria de Diseno Textil SA	500.132	0,50
17.628	Mapfre SA	27.923	0,03
8.509	Naturgy Energy Group SA	140.952	0,14
7.830	Red Electrica Corp SA	130.017	0,13
26.670	Repsol SA	207.653	0,21
4.074	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	64.288	0,06
88.824	Telefonica SA	377.236	0,38
	<b>Spanien insgesamt</b>	<b>5.349.612</b>	<b>5,35</b>
<b>Schweden</b>			
2.676	AAK AB	40.942	0,04
5.475	Alfa Laval AB	106.945	0,11
18.679	Assa Abloy AB	338.176	0,34
7.240	Atlas Copco AB	238.423	0,24
11.797	Atlas Copco AB	444.860	0,45
1.545	Axfood AB	30.031	0,03
4.990	Boliden AB	101.095	0,10
3.824	Castellum AB	63.604	0,06
4.632	Electrolux AB	68.965	0,07
5.951	Elektro AB	49.284	0,05

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (Fortsetzung)</b>			
14.835	Epiroc AB	161.546	0,16
7.319	Epiroc AB	81.204	0,08
9.700	EQT AB	154.943	0,16
11.165	Essity AB	321.265	0,32
2.438	Evolution Gaming Group AB '144A'	129.447	0,13
4.585	Fabege AB	47.716	0,05
1.709	Fastighets AB Balder - Class B	57.995	0,06
3.702	Getinge AB	61.168	0,06
13.472	Hennes & Mauritz AB	173.804	0,17
5.096	Hexagon AB	264.925	0,27
1.958	Holmen AB	55.610	0,06
5.934	Husqvarna AB	43.268	0,04
1.510	ICA Gruppen AB	63.752	0,06
1.452	Industrivarden AB	29.292	0,03
3.477	Industrivarden AB - Class A	70.243	0,07
1.814	Investment AB Latour	29.297	0,03
8.394	Investor AB	394.424	0,39
2.801	Investor AB	130.411	0,13
4.059	Kinnevik AB	95.073	0,10
821	L E Lundbergforetagen AB	33.172	0,03
2.692	Lundin Energy AB	57.780	0,06
7.817	Nibe Industrier AB	153.812	0,15
1.546	Saab AB	34.365	0,03
18.889	Sandvik AB	314.270	0,31
5.598	Securitas AB	67.165	0,07
25.735	Skandinaviska Enskilda Banken AB	198.469	0,20
8.234	Skandinaviska Enskilda Banken AB	66.334	0,07
7.051	Skanska AB	127.689	0,13

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (Fortsetzung)</b>			
7.657	SKF AB	126.700	0,13
4.929	SSAB AB - Class A	12.082	0,01
7.745	SSAB AB - Class B	18.282	0,02
11.181	Svenska Cellulosa AB SCA - Class B	118.390	0,12
26.587	Svenska Handelsbanken AB	224.705	0,22
21.063	Swedbank AB	240.336	0,24
2.832	Swedish Match AB	177.267	0,18
2.911	Swedish Orphan Biovitrum AB	59.866	0,06
8.240	Tele2 AB	97.289	0,10
56.231	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	462.995	0,46
37.093	Telia Co AB	123.358	0,12
4.494	Trelleborg AB	58.257	0,06
30.290	Volvo AB	422.327	0,42
6.095	Volvo AB	83.409	0,08
	<b>Schweden insgesamt</b>	<b>7.126.027</b>	<b>7,13</b>
<b>Schweiz</b>			
34.499	ABB Ltd	691.428	0,69
8.793	Alcon Inc	449.124	0,45
9.312	Cie Financiere Richemont SA	528.831	0,53
45.952	Credit Suisse Group AG	423.050	0,42
710	Geberit AG	316.351	0,32
141	Givaudan SA	467.409	0,47
1.177	Kuehne + Nagel International AG	174.073	0,17
10.057	LafargeHolcim Ltd	392.257	0,39
1.392	Lonza Group AG	654.233	0,65
53.942	Nestle SA	5.308.711	5,32
44.108	Novartis AG	3.415.855	3,42



## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz (Fortsetzung)</b>			
306	Partners Group Holding AG	247.096	0,25
428	Roche Holding AG	130.700	0,13
13.196	Roche Holding AG	4.071.259	4,08
246	Schindler Holding AG	51.592	0,05
881	Schindler Holding AG	184.599	0,18
86	SGS SA	187.068	0,19
2.570	Sika AG	440.340	0,44
509	Swatch Group AG/The	90.440	0,09
577	Swatch Group AG/The	20.092	0,02
5.400	Swiss Re AG	370.700	0,37
437	Swisscom AG	203.622	0,20
68.145	UBS Group AG	698.247	0,70
2.975	Zurich Insurance Group AG	934.206	0,94
	<b>Schweiz insgesamt</b>	<b>20.451.283</b>	<b>20,47</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
6.003	Amarin Corp Plc ADR	36.985	0,04
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>36.985</b>	<b>0,04</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>99.611.089</b>	<b>99,73</b>
<b>Gesamtanlagen</b>		<b>Wert €</b>	<b>% des Nettover- mögens</b>
	Stammaktien	99.611.089	99,73
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	265.170	0,27
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>99.876.259</b>	<b>100,00</b>

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

Zum 30. Juni 2020

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,73
Sonstige Vermögenswerte		0,27
		<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %)</b>			
<b>Australien</b>			
5.854	Afterpay Ltd	245.822	0,52
20.070	AGL Energy Ltd	235.604	0,50
68.170	Alumina Ltd	76.271	0,16
106.416	AMP Ltd	135.913	0,29
7.397	Ampol Ltd	149.324	0,32
32.445	APA Group	248.630	0,52
18.478	Aristocrat Leisure Ltd	324.418	0,68
6.114	ASX Ltd	359.411	0,76
58.003	Aurizon Holdings Ltd	196.483	0,41
45.126	AusNet Services	51.886	0,11
77.024	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	988.513	2,09
89.029	BHP Group Ltd	2.195.671	4,63
16.335	BlueScope Steel Ltd	131.475	0,28
25.381	Boral Ltd	66.231	0,14
48.433	Brambles Ltd	362.478	0,77
13.185	Challenger Ltd	40.034	0,08
1.970	CIMIC Group Ltd	32.715	0,07
10.618	Coca-Cola Amatil Ltd	63.310	0,13
1.899	Cochlear Ltd	247.022	0,52
39.116	Coles Group Ltd	462.418	0,98
52.231	Commonwealth Bank of Australia	2.496.452	5,27
12.715	Computershare Ltd	115.996	0,25
6.339	Crown Resorts Ltd	42.204	0,09
13.508	CSL Ltd	2.669.213	5,63
30.607	Dexus (Units) (REIT)	193.874	0,41
45.027	Evolution Mining Ltd	175.779	0,37
47.907	Fortescue Metals Group Ltd	456.835	0,96
52.634	Goodman Group (REIT)	538.150	1,14
62.967	GPT Group/The (REIT)	180.784	0,38

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Australien (Fortsetzung)</b>			
63.976	Insurance Australia Group Ltd	254.158	0,54
18.180	Lendlease Group	154.837	0,33
10.224	Macquarie Group Ltd	834.864	1,76
3.975	Magellan Financial Group Ltd	158.763	0,34
91.546	Medibank Pvt Ltd	188.461	0,40
117.059	Mirvac Group (Units) (REIT)	174.894	0,37
85.867	National Australia Bank Ltd	1.077.172	2,27
21.890	Newcrest Mining Ltd	475.204	1,00
19.823	Northern Star Resources Ltd	182.342	0,39
11.110	Orica Ltd	127.285	0,27
47.890	Origin Energy Ltd	192.561	0,41
46.608	Qantas Airways Ltd	121.300	0,26
43.734	QBE Insurance Group Ltd	266.786	0,56
4.716	Ramsay Health Care Ltd	215.991	0,46
2.200	REA Group Ltd	163.408	0,35
10.546	Rio Tinto Ltd	711.290	1,50
64.014	Santos Ltd	233.594	0,49
166.163	Scentre Group (REIT)	248.259	0,52
14.516	Sonic Healthcare Ltd	304.130	0,64
146.944	South32 Ltd	206.392	0,44
73.545	Stockland (REIT)	167.607	0,35
32.974	Suncorp Group Ltd	209.548	0,44
61.320	Sydney Airport	239.384	0,51
73.453	Tabcorp Holdings Ltd	170.937	0,36
352.043	Telstra Corp Ltd	758.665	1,60
78.274	Transurban Group	761.500	1,61
18.615	Treasury Wine Estates Ltd	134.318	0,28
63.106	Vicinity Centres (REIT)	62.132	0,13
32.374	Wesfarmers Ltd	999.253	2,11

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Australien (Fortsetzung)</b>			
107.757	Westpac Banking Corp	1.331.742	2,81
2.408	WiseTech Global Ltd	32.081	0,07
29.343	Woodside Petroleum Ltd	437.394	0,92
36.189	Woolworths Group Ltd	928.887	1,96
	<b>Australien insgesamt</b>	<b>26.008.055</b>	<b>54,91</b>
<b>Bermuda</b>			
111.805	Alibaba Health Information Technology Ltd	326.019	0,69
49.971	China Gas Holdings Ltd	154.095	0,33
14.808	CK Infrastructure Holdings Ltd	76.233	0,16
4.186	Dairy Farm International Holdings Ltd	19.465	0,04
25.663	Haier Electronics Group Co Ltd	77.647	0,16
39.653	Hongkong Land Holdings Ltd	163.767	0,35
7.384	Jardine Matheson Holdings Ltd	308.208	0,65
6.537	Jardine Strategic Holdings Ltd	140.872	0,30
24.232	Kerry Properties Ltd	62.531	0,13
31.677	NWS Holdings Ltd	27.343	0,06
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>1.356.180</b>	<b>2,87</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
8.280	ASM Pacific Technology Ltd	86.908	0,18
54.200	Budweiser Brewing Co APAC Ltd '144A'	157.695	0,33
22.885	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	21.880	0,05
70.542	CK Asset Holdings Ltd	420.497	0,89
78.259	CK Hutchison Holdings Ltd	502.848	1,06
152.623	Geely Automobile Holdings Ltd	240.244	0,51
14.315	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	222.169	0,47
11.139	MGM China Holdings Ltd	14.372	0,03
70.753	Sands China Ltd	277.518	0,59

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Cayman-Inseln (Fortsetzung)</b>			
38.264	Shimao Group Holdings Ltd	161.934	0,34
173.567	Sino Biopharmaceutical Ltd	326.959	0,69
260.265	WH Group Ltd '144A'	222.976	0,47
22.228	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	106.115	0,22
39.463	Wynn Macau Ltd	67.923	0,14
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>2.830.038</b>	<b>5,97</b>
<b>Hongkong</b>			
357.895	AIA Group Ltd	3.338.622	7,05
35.392	Bank of East Asia Ltd/The	80.826	0,17
5.000	Cathay Pacific Airways Ltd	4.838	0,01
51.407	CLP Holdings Ltd	504.091	1,06
165.829	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	313.238	0,66
53.494	Fosun International Ltd	68.054	0,14
64.357	Galaxy Entertainment Group Ltd	438.018	0,92
45.839	Hang Lung Properties Ltd	108.588	0,23
20.139	Hang Seng Bank Ltd	338.056	0,71
38.136	Henderson Land Development Co Ltd	144.662	0,31
43.699	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	45.332	0,10
106.342	HKT Trust & HKT Ltd	155.593	0,33
293.948	Hong Kong & China Gas Co Ltd	455.119	0,96
38.315	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	1.631.384	3,44
59.429	Link REIT (Units) (REIT)	485.756	1,03
41.862	MTR Corp Ltd	216.860	0,46
40.107	New World Development Co Ltd	190.433	0,40
36.682	Power Assets Holdings Ltd	199.491	0,42
157.832	Sino Land Co Ltd	198.551	0,42
41.671	SJM Holdings Ltd	46.239	0,10
61.463	Sun Art Retail Group Ltd	104.997	0,22

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Hongkong (Fortsetzung)</b>			
43.591	Sun Hung Kai Properties Ltd	556.527	1,17
43.050	Swire Pacific Ltd	41.048	0,09
9.590	Swire Pacific Ltd	50.855	0,11
25.805	Swire Properties Ltd	65.524	0,14
39.077	Techtronic Industries Co Ltd	382.176	0,81
22.849	Wharf Holdings Ltd/The	46.462	0,10
15.920	Wheelock & Co Ltd*	125.915	0,27
	<b>Hongkong insgesamt</b>	<b>10.337.255</b>	<b>21,83</b>
<b>Neuseeland</b>			
20.220	a2 Milk Co Ltd	262.810	0,55
23.543	Auckland International Airport Ltd	99.575	0,21
30.914	Contact Energy Ltd	124.581	0,26
3.585	EBOS Group Ltd	49.873	0,11
16.551	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	379.313	0,80
17.979	Fletcher Building Ltd	42.824	0,09
12.510	Genesis Energy Ltd	24.402	0,05
42.255	Goodman Property Trust (Units) (REIT)	55.220	0,12
14.485	Infratil Ltd	43.827	0,09
3.030	Mainfreight Ltd	76.853	0,16
12.909	Mercury NZ Ltd	39.058	0,08
36.862	Meridian Energy Ltd	114.143	0,24
14.334	Ryman Healthcare Ltd	120.698	0,25
50.336	Spark New Zealand Ltd	147.764	0,31
2.804	Xero Ltd	173.965	0,37
	<b>Neuseeland insgesamt</b>	<b>1.754.906</b>	<b>3,69</b>

## L&amp;G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Papua-Neuguinea</b>			
44.238	Oil Search Ltd	96.553	0,20
<b>Papua-Neuguinea insgesamt</b>		<b>96.553</b>	<b>0,20</b>
<b>Singapur</b>			
91.613	Ascendas Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	208.177	0,44
104.414	CapitalLand Commercial Trust (Units) (REIT)	126.492	0,27
88.731	CapitalLand Ltd	185.727	0,39
87.586	CapitalLand Mall Trust (Units) (REIT)	123.057	0,26
13.076	City Developments Ltd	78.923	0,17
47.329	ComfortDelGro Corp Ltd	49.194	0,10
50.296	DBS Group Holdings Ltd	749.917	1,58
123.745	Genting Singapore Ltd	67.415	0,14
2.220	Jardine Cycle & Carriage Ltd	32.082	0,07
52.156	Keppel Corp Ltd	222.826	0,47
41.686	Keppel DC REIT (REIT)	75.900	0,16
47.465	Mapletree Commercial Trust (REIT)	65.667	0,14
30.955	Mapletree Industrial Trust (Units) (REIT)	63.684	0,13
56.783	Mapletree Logistics Trust (Units) (REIT)	78.965	0,17
117.837	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	760.222	1,60
11.091	SATS Ltd	22.738	0,05
16.807	Sembcorp Industries Ltd	21.084	0,04
46.630	Singapore Airlines Ltd	124.678	0,26
24.545	Singapore Exchange Ltd	146.739	0,31
27.924	Singapore Press Holdings Ltd	25.421	0,05
45.074	Singapore Technologies Engineering Ltd	106.624	0,23
227.575	Singapore Telecommunications Ltd	401.306	0,85
37.191	Suntec Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	37.590	0,08
45.132	United Overseas Bank Ltd	654.480	1,38



## L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,72 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Singapur (Fortsetzung)</b>			
11.380	UOL Group Ltd	55.390	0,12
6.980	Venture Corp Ltd	80.956	0,17
52.192	Wilmar International Ltd	153.018	0,32
119.737	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	79.823	0,17
<b>Singapur insgesamt</b>		<b>4.798.095</b>	<b>10,12</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>47.181.082</b>	<b>99,59</b>

Nominal	Beschreibung	Fälligkeits- termin	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Unternehmensanleihen (30. Juni 2019: – %)</b>				
<b>Singapur</b>				
41.571	Singapore Airlines Ltd (Zero Coupon)	08.06.2030	29.799	0,06
<b>Singapur insgesamt</b>			<b>29.799</b>	<b>0,06</b>
<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>			<b>29.799</b>	<b>0,06</b>

<b>Gesamtanlagen</b>				
Stammaktien			47.181.082	99,59
Unternehmensanleihen			29.799	0,06
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			166.333	0,35
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>			<b>47.377.214</b>	<b>100,00</b>

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>				% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere				99,64
Sonstige Vermögenswerte				0,36
				<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.				

\* Der Handel dieses Wertpapiers wurde ausgesetzt.

**L&G Clean Water UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %)</b>			
<b>Bermuda</b>			
529.297	Beijing Enterprises Water Group Ltd	206.243	1,33
167.260	China Water Affairs Group Ltd	120.420	0,78
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>326.663</b>	<b>2,11</b>
<b>Brasilien</b>			
21.468	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR	225.629	1,45
	<b>Brasilien insgesamt</b>	<b>225.629</b>	<b>1,45</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
142.383	China Lesso Group Holdings Ltd	185.179	1,19
8.715	Consolidated Water Co Ltd	125.757	0,81
	<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>	<b>310.936</b>	<b>2,00</b>
<b>Finnland</b>			
22.474	Kemira Oyj	289.275	1,86
61.941	Metso Outotec Oyj	341.729	2,20
12.921	Uponor Oyj	173.860	1,12
	<b>Finnland insgesamt</b>	<b>804.864</b>	<b>5,18</b>
<b>Frankreich</b>			
3.232	Arkema SA	309.066	1,99
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>309.066</b>	<b>1,99</b>
<b>Deutschland</b>			
5.299	LANXESS AG	279.491	1,80
	<b>Deutschland insgesamt</b>	<b>279.491</b>	<b>1,80</b>

**L&G Clean Water UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Hongkong</b>			
117.931	Guangdong Investment Ltd	202.373	1,30
	<b>Hongkong insgesamt</b>	<b>202.373</b>	<b>1,30</b>
<b>Irland</b>			
6.169	Pentair Plc	234.360	1,51
	<b>Irland insgesamt</b>	<b>234.360</b>	<b>1,51</b>
<b>Japan</b>			
29.845	Kitz Corp	190.050	1,22
10.741	Kurita Water Industries Ltd	297.783	1,92
7.055	METAWATER Co Ltd	323.699	2,09
5.159	Organo Corp	278.309	1,79
18.768	Sekisui Chemical Co Ltd	268.251	1,73
	<b>Japan insgesamt</b>	<b>1.358.092</b>	<b>8,75</b>
<b>Luxemburg</b>			
443	Eurofins Scientific SE	277.940	1,79
	<b>Luxemburg insgesamt</b>	<b>277.940</b>	<b>1,79</b>
<b>Niederlande</b>			
8.446	Aalberts NV	276.905	1,78
	<b>Niederlande insgesamt</b>	<b>276.905</b>	<b>1,78</b>
<b>Schweden</b>			
13.150	Alfa Laval AB	288.501	1,86
	<b>Schweden insgesamt</b>	<b>288.501</b>	<b>1,86</b>

**L&G Clean Water UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz</b>			
527	Geberit AG	263.735	1,70
3.470	Sulzer AG	276.485	1,78
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>540.220</b>	<b>3,48</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
9.645	Halma Plc	274.457	1,77
78.198	Rotork Plc	270.540	1,74
7.837	Severn Trent Plc	240.051	1,55
20.400	United Utilities Group Plc	229.427	1,48
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>1.014.475</b>	<b>6,54</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>			
5.998	Advanced Drainage Systems Inc	296.301	1,91
14.179	Aegion Corp - Class A	225.021	1,45
1.721	American Water Works Co Inc	221.424	1,43
7.576	Atkore International Group Inc	207.204	1,34
4.034	Badger Meter Inc	253.819	1,64
22.135	Cadiz Inc	224.892	1,45
4.824	California Water Service Group	230.105	1,48
3.980	Crane Co	236.651	1,53
1.562	Danaher Corp	276.208	1,78
1.227	Ecolab Inc	244.112	1,57
18.198	Energy Recovery Inc	138.214	0,89
5.748	Essential Utilities Inc	242.796	1,56
13.902	Evoqua Water Technologies Corp	258.577	1,67
25.989	Exterran Corp	140.081	0,90
4.714	Franklin Electric Co Inc	247.579	1,60
4.870	Gorman-Rupp Co/The	151.360	0,98

## L&amp;G Clean Water UCITS ETF

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
1.688	IDEX Corp	266.772	1,72
869	IDEXX Laboratories Inc	286.909	1,85
5.840	Ingevity Corp	307.009	1,98
3.604	Itron Inc	238.765	1,54
2.979	Kadant Inc	296.887	1,91
2.691	Lindsay Corp	248.137	1,60
328	Mettler-Toledo International Inc	264.220	1,70
3.978	Middlesex Water Co	267.242	1,72
23.451	Mueller Water Products Inc - Class A	221.143	1,43
21.700	National Oilwell Varco Inc	265.825	1,71
9.317	Northwest Pipe Co	233.577	1,51
1.329	Rockwell Automation Inc	283.077	1,82
705	Roper Technologies Inc	273.723	1,76
3.551	SJW Group	220.553	1,42
8.419	SPX FLOW Inc	315.207	2,03
2.726	Tetra Tech Inc	215.681	1,39
7.792	Trimble Inc	336.536	2,17
1.197	Waters Corp	215.939	1,39
2.534	Watts Water Technologies Inc - Class A	205.254	1,32
3.063	Xylem Inc/NY	198.972	1,28
5.466	York Water Co/The	262.149	1,69
	<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>	<b>9.017.921</b>	<b>58,12</b>
	<b>Stammaktien insgesamt</b>	<b>15.467.436</b>	<b>99,66</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
	Stammaktien	15.467.436	99,66
	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	53.177	0,34
	<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>15.520.613</b>	<b>100,00</b>

**L&G Clean Water UCITS ETF****Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Zum 30. Juni 2020

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	99,62
Sonstige Vermögenswerte	0,38
	<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.	

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %)</b>			
<b>Australien</b>			
55.072	Appen Ltd	1.286.166	1,55
<b>Australien insgesamt</b>		<b>1.286.166</b>	<b>1,55</b>
<b>Kanada</b>			
1.390	Shopify Inc	1.319.388	1,59
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>1.319.388</b>	<b>1,59</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
5.093	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.098.560	1,33
11.637	Baidu Inc ADR	1.395.160	1,68
18.940	JD.com Inc ADR	1.139.809	1,38
23.727	Tencent Holdings Ltd	1.526.400	1,84
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>5.159.929</b>	<b>6,23</b>
<b>China</b>			
61.376	Iflytek Co Ltd	324.749	0,39
<b>China insgesamt</b>		<b>324.749</b>	<b>0,39</b>
<b>Frankreich</b>			
8.585	Capgemini SE	983.045	1,19
7.057	Dassault Systemes SE	1.217.467	1,47
22.920	Talend SA ADR	794.407	0,96
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>2.994.919</b>	<b>3,62</b>
<b>Deutschland</b>			
42.393	Infineon Technologies AG	993.954	1,20
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>993.954</b>	<b>1,20</b>

## L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland</b>			
5.618	Accenture Plc - Class A	1.206.297	1,46
<b>Irland insgesamt</b>		<b>1.206.297</b>	<b>1,46</b>
<b>Israel</b>			
5.493	Wix.com Ltd	1.407.416	1,70
<b>Israel insgesamt</b>		<b>1.407.416</b>	<b>1,70</b>
<b>Luxemburg</b>			
6.357	Spotify Technology SA	1.641.314	1,98
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>1.641.314</b>	<b>1,98</b>
<b>Niederlande</b>			
3.279	ASML Holding NV NY Reg Shrs	1.206.770	1,46
27.682	Yandex NV - Class A	1.384.654	1,67
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>2.591.424</b>	<b>3,13</b>
<b>Taiwan</b>			
70.123	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	743.904	0,90
<b>Taiwan insgesamt</b>		<b>743.904</b>	<b>0,90</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
7.639	Atlassian Corp Plc	1.377.082	1,66
75.058	Blue Prism Group plc	1.054.473	1,27
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>2.431.555</b>	<b>2,93</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>			
2.416	Adobe Inc	1.051.709	1,27
15.877	Advanced Micro Devices Inc	835.289	1,01



## L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
924	Alphabet Inc - Class A	1.310.278	1,58
9.745	Alteryx Inc - Class A	1.600.909	1,93
536	Amazon.com Inc	1.478.727	1,78
10.685	Analog Devices Inc	1.310.408	1,58
5.208	Arista Networks Inc	1.093.836	1,32
8.608	Aspen Technology Inc	891.875	1,08
5.012	Autodesk Inc	1.198.820	1,45
524	Booking Holdings Inc	834.386	1,01
68.413	Cloudera Inc	870.213	1,05
42.029	Cloudflare Inc	1.510.942	1,82
17.455	Cognex Corp	1.042.413	1,26
22.766	Cornerstone OnDemand Inc	877.857	1,06
8.025	Electronic Arts Inc	1.059.701	1,28
11.386	Etsy Inc	1.209.535	1,46
3.164	Fair Isaac Corp	1.322.679	1,60
9.235	Fiserv Inc	901.521	1,09
18.914	Grubhub Inc	1.329.654	1,61
6.286	HubSpot Inc	1.410.264	1,70
3.759	Illumina Inc	1.392.146	1,68
33.147	Intellia Therapeutics Inc	696.750	0,84
10.081	International Business Machines Corp	1.217.482	1,47
3.850	Intuit Inc	1.140.331	1,38
16.234	iRobot Corp	1.362.033	1,64
3.841	Lam Research Corp	1.242.410	1,50
1.095	MercadoLibre Inc	1.079.418	1,30
7.111	Microsoft Corp	1.447.160	1,75
5.916	MongoDB Inc	1.339.027	1,62
2.791	Netflix Inc	1.270.017	1,53

## L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
17.503	New Relic Inc	1.205.957	1,46
58.983	Nuance Communications Inc	1.492.565	1,80
3.581	NVIDIA Corp	1.360.458	1,64
4.334	Palo Alto Networks Inc	995.390	1,20
8.689	Proofpoint Inc	965.522	1,17
46.986	Pure Storage Inc	814.267	0,98
24.001	Rapid7 Inc	1.224.531	1,48
7.656	salesforce.com Inc	1.434.198	1,73
3.000	ServiceNow Inc	1.215.180	1,47
7.270	Splunk Inc	1.444.549	1,74
12.434	Square Inc	1.304.824	1,58
12.371	Teradyne Inc	1.045.473	1,26
1.142	Tesla Inc	1.233.143	1,49
4.827	Twilio Inc - Class A	1.059.140	1,28
13.908	Varonis Systems Inc	1.230.580	1,49
6.564	Veeva Systems Inc - Class A	1.538.733	1,86
45.993	Veracyte Inc	1.191.219	1,44
7.052	Verisk Analytics Inc - Class A	1.200.250	1,45
13.007	Xilinx Inc	1.279.759	1,54
48.426	Yext Inc	804.356	0,97
14.160	Zendesk Inc	1.253.585	1,51
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>60.621.469</b>	<b>73,19</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>82.722.484</b>	<b>99,87</b>

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

Zum 30. Juni 2020

Gesamtanlagen	Wert US\$	% des Nettover- mögens
Stammaktien	82.722.484	99,87
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	111.783	0,13
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>82.834.267</b>	<b>100,00</b>
Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamt- vermö- gens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,83
Sonstige Vermögenswerte		0,17
		<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.		

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %)</b>			
<b>Australien</b>			
1.854	CSL Ltd	366.355	1,10
<b>Australien insgesamt</b>		<b>366.355</b>	<b>1,10</b>
<b>Belgien</b>			
12.508	Materialise NV ADR	282.180	0,85
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>282.180</b>	<b>0,85</b>
<b>Kanada</b>			
2.503	Novanta Inc	267.245	0,80
<b>Kanada insgesamt</b>		<b>267.245</b>	<b>0,80</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
36.183	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd '144A'	550.417	1,66
<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>		<b>550.417</b>	<b>1,66</b>
<b>Dänemark</b>			
5.174	GN Store Nord A/S	275.544	0,83
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>275.544</b>	<b>0,83</b>
<b>Frankreich</b>			
30.143	Cellectis SA ADR	536.545	1,61
<b>Frankreich insgesamt</b>		<b>536.545</b>	<b>1,61</b>
<b>Deutschland</b>			
9.574	Siemens Healthineers AG '144A'	458.625	1,38
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>458.625</b>	<b>1,38</b>

## L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland</b>			
1.760	ICON Plc	296.490	0,89
<b>Irland insgesamt</b>		<b>296.490</b>	<b>0,89</b>
<b>Italien</b>			
2.523	DiaSorin SpA	482.873	1,45
<b>Italien insgesamt</b>		<b>482.873</b>	<b>1,45</b>
<b>Japan</b>			
6.594	Terumo Corp	249.433	0,75
<b>Japan insgesamt</b>		<b>249.433</b>	<b>0,75</b>
<b>Jersey</b>			
7.241	Novocure Ltd	429.391	1,29
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>429.391</b>	<b>1,29</b>
<b>Luxemburg</b>			
574	Eurofins Scientific SE	360.129	1,08
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>360.129</b>	<b>1,08</b>
<b>Niederlande</b>			
8.834	Koninklijke Philips NV	411.965	1,24
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>411.965</b>	<b>1,24</b>
<b>Spanien</b>			
11.037	Grifols SA	335.076	1,01
<b>Spanien insgesamt</b>		<b>335.076</b>	<b>1,01</b>

## L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz</b>			
5.390	CRISPR Therapeutics AG	396.111	1,19
887	Lonza Group AG	468.233	1,41
1.136	Roche Holding AG	393.650	1,18
1.286	Tecan Group AG	455.468	1,37
	<b>Schweiz insgesamt</b>	<b>1.713.462</b>	<b>5,15</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
18.768	EMIS Group Plc	250.449	0,75
15.524	Smith & Nephew Plc	288.777	0,87
	<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>	<b>539.226</b>	<b>1,62</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>			
38.635	3D Systems Corp	270.059	0,81
3.569	Abbott Laboratories	326.314	0,98
1.975	ABIOMED Inc	477.081	1,43
4.367	Agilent Technologies Inc	385.912	1,16
1.387	Align Technology Inc	380.648	1,14
1.933	Alnylam Pharmaceuticals Inc	286.297	0,86
45.646	Axogen Inc	421.769	1,27
3.513	Baxter International Inc	302.469	0,91
1.121	Becton Dickinson and Co	268.222	0,81
3.130	BioMarin Pharmaceutical Inc	386.054	1,16
981	Bio-Rad Laboratories Inc	442.912	1,33
8.306	BioTelemetry Inc	375.348	1,13
12.708	Boston Scientific Corp	446.178	1,34
4.948	Bristol-Myers Squibb Co	290.942	0,88
8.069	Brooks Automation Inc	356.973	1,07
11.295	Cardiovascular Systems Inc	356.357	1,07

## L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
5.746	Catalent Inc	421.182	1,27
48.925	Cerus Corp	322.905	0,97
2.765	Charles River Laboratories International Inc	482.078	1,45
30.688	Codexis Inc	349.843	1,05
3.742	CONMED Corp	269.387	0,81
16.422	CryoLife Inc	314.810	0,95
2.777	Danaher Corp	491.057	1,48
677	DexCom Inc	274.456	0,83
9.254	Editas Medicine Inc	273.733	0,82
5.540	Edwards Lifesciences Corp	382.869	1,15
5.234	Exact Sciences Corp	455.044	1,37
10.537	Glaukos Corp	404.832	1,22
4.658	Globus Medical Inc	222.233	0,67
7.155	Hologic Inc	407.835	1,23
1.393	Illumina Inc	515.898	1,55
4.855	Incyte Corp	504.774	1,52
2.756	Insulet Corp	535.381	1,61
8.880	Integra LifeSciences Holdings Corp	417.271	1,25
16.488	Intellia Therapeutics Inc	346.578	1,04
833	Intuitive Surgical Inc	474.668	1,43
21.627	Invitae Corp	655.082	1,97
3.002	IQVIA Holdings Inc	425.924	1,28
2.055	iRhythm Technologies Inc	238.154	0,72
4.312	Livongo Health Inc	324.219	0,98
1.647	Masimo Corp	375.500	1,13
4.462	Medpace Holdings Inc	415.055	1,25
4.240	Moderna Inc	272.250	0,82
12.287	NanoString Technologies Inc	360.623	1,08

## L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (30. Juni 2019: 99,76 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
12.172	Natera Inc	606.896	1,83
16.484	NeoGenomics Inc	510.674	1,54
3.266	Nevro Corp	390.189	1,17
21.862	Nuance Communications Inc	553.218	1,66
6.140	OmniceIl Inc	433.607	1,30
2.646	Penumbra Inc	473.158	1,42
3.900	PerkinElmer Inc	382.551	1,15
2.682	Quidel Corp	600.071	1,80
761	Regeneron Pharmaceuticals Inc	474.598	1,43
10.285	STAAR Surgical Co	632.939	1,90
1.799	Stryker Corp	324.162	0,97
8.196	Tabula Rasa HealthCare Inc	448.567	1,35
7.138	Tactile Systems Technology Inc	295.727	0,89
1.526	Teladoc Health Inc	291.222	0,88
1.393	Thermo Fisher Scientific Inc	504.740	1,52
3.727	Varian Medical Systems Inc	456.632	1,37
1.217	Veeva Systems Inc - Class A	285.289	0,86
17.048	Veracyte Inc	441.543	1,33
1.393	Vertex Pharmaceuticals Inc	404.402	1,22
22.305	Vocera Communications Inc	472.866	1,42
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>25.690.227</b>	<b>77,26</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>33.245.183</b>	<b>99,97</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		33.245.183	99,97
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		10.965	0,03
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>33.256.148</b>	<b>100,00</b>



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

Zum 30. Juni 2020

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere		99,93
Sonstige Vermögenswerte		0,07
		<b>100,00</b>
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 (ungeprüft)**

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien</b>			
<b>Österreich</b>			
2.312	ams AG	30.533	0,03
577	ANDRITZ AG	18.695	0,02
823	BAWAG Group AG '144A'	25.299	0,03
3.033	Erste Group Bank AG	63.541	0,07
1.037	Raiffeisen Bank International AG	16.447	0,02
1.581	Verbund AG	63.019	0,07
1.056	voestalpine AG	20.217	0,02
1.550	Wienerberger AG	30.055	0,03
<b>Österreich insgesamt</b>		<b>267.806</b>	<b>0,29</b>
<b>Belgien</b>			
489	Ackermans & van Haaren NV	56.920	0,06
382	Aedifica SA (REIT)	37.169	0,04
2.192	Ageas SA/NV	69.136	0,07
10.564	Anheuser-Busch InBev SA/NV	463.390	0,50
296	Cofinimmo SA (REIT)	36.230	0,04
604	Colruyt SA	29.578	0,03
797	Elia Group SA/NV	76.990	0,08
538	Galapagos NV	94.177	0,10
882	Groupe Bruxelles Lambert SA	65.868	0,07
4.001	KBC Group NV	204.291	0,22
1.493	Proximus SADP	27.083	0,03
162	Sofina SA	38.070	0,04
831	Solvay SA	59.217	0,06
1.603	UCB SA	165.269	0,18
2.182	Umicore SA	91.448	0,10
2.166	Warehouses De Pauw CVA (REIT)	52.634	0,06
<b>Belgien insgesamt</b>		<b>1.567.470</b>	<b>1,68</b>

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF\*

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Bermuda</b>			
3.413	Hiscox Ltd	29.609	0,03
<b>Bermuda insgesamt</b>		<b>29.609</b>	<b>0,03</b>
<b>Dänemark</b>			
2.738	Ambu A/S - Class B	76.557	0,08
70	AP Moller - Maersk A/S - Class B	72.580	0,08
1.100	Carlsberg AS	129.374	0,14
1.082	Chr Hansen Holding A/S	99.297	0,11
2.034	Coloplast A/S	280.541	0,30
943	Demant A/S	22.129	0,02
2.915	DSV PANALPINA A/S	316.715	0,34
857	Genmab A/S	255.262	0,27
1.901	GN Store Nord A/S	90.137	0,10
1.226	H Lundbeck A/S	41.024	0,04
2.055	ISS A/S	28.950	0,03
835	Netcompany Group A/S '144A'	48.734	0,05
21.500	Novo Nordisk A/S	1.238.663	1,33
2.268	Novozymes A/S	116.697	0,13
2.492	Orsted A/S '144A'	255.911	0,28
1.257	Pandora A/S	60.765	0,07
176	ROCKWOOL International A/S	42.387	0,05
660	Royal Unibrew A/S	48.863	0,05
462	SimCorp A/S	44.320	0,05
1.494	Topdanmark A/S	54.923	0,06
1.390	Tryg A/S	35.807	0,04
2.302	Vestas Wind Systems A/S	208.602	0,22
<b>Dänemark insgesamt</b>		<b>3.568.238</b>	<b>3,84</b>

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Färöer Inseln</b>			
570	Bakkafrost P/F	31.853	0,03
<b>Färöer Inseln insgesamt</b>		<b>31.853</b>	<b>0,03</b>
<b>Finnland</b>			
1.566	Elisa Oyj	84.783	0,09
894	Huhtamaki Oyj	31.326	0,03
2.568	Kesko Oyj	39.085	0,04
1.564	Kojamo Oyj	29.403	0,03
4.434	Kone Oyj - Class B	271.449	0,29
1.322	Metso Oyj	38.563	0,04
5.027	Neste Oyj	174.990	0,19
72.091	Nokia Oyj	280.326	0,30
1.418	Nokian Renkaat Oyj	27.708	0,03
53.071	Nordea Bank Abp	326.160	0,35
997	Orion Oyj	42.931	0,05
6.658	Sampo Oyj - Class A	203.868	0,22
9.377	Stora Enso Oyj	99.678	0,11
7.633	UPM-Kymmene Oyj	196.321	0,21
1.427	Valmet Oyj	33.149	0,04
3.512	Wartsila OYJ Abp	25.841	0,03
<b>Finnland insgesamt</b>		<b>1.905.581</b>	<b>2,05</b>
<b>Frankreich</b>			
1.837	Accor SA	44.474	0,05
341	Aeroports de Paris	31.167	0,03
6.115	Air Liquide SA	785.166	0,85
2.173	Alstom SA	89.984	0,10
278	Alten SA	21.281	0,02

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (Fortsetzung)</b>			
665	Amundi SA '144A'	46.350	0,05
908	Arkema SA	77.307	0,08
1.259	Atos SE	95.558	0,10
26.441	AXA SA	492.120	0,53
517	BioMerieux	63.229	0,07
14.523	BNP Paribas SA	513.679	0,55
6.494	Bollore SA	18.157	0,02
3.225	Bouygues SA	98.072	0,11
3.599	Bureau Veritas SA	67.589	0,07
2.278	Capgemini SE	232.242	0,25
6.457	Carrefour SA	88.816	0,10
7.131	Cie de Saint-Gobain	228.549	0,25
2.441	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	225.402	0,24
2.211	CNP Assurances	22.663	0,02
777	Covivio (REIT)	50.117	0,05
12.468	Credit Agricole SA	105.080	0,11
8.355	Danone SA	514.334	0,55
1.886	Dassault Systemes SE	289.690	0,31
2.604	Edenred	101.374	0,11
1.120	Eiffage SA	91.168	0,10
7.189	Electricite de France SA	59.022	0,06
2.571	Elis SA	26.713	0,03
24.592	Engie SA	270.512	0,29
3.627	EssilorLuxottica SA	414.385	0,45
414	Eurazeo SE	18.887	0,02
957	Faurecia SE	33.275	0,04
703	Gecina SA (REIT)	77.330	0,08
5.354	Getlink SE	68.745	0,07

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (Fortsetzung)</b>			
442	Hermes International	328.760	0,35
507	ICADE (REIT)	31.434	0,03
171	Iliad SA	29.694	0,03
813	Ingenico Group SA	115.446	0,12
493	Ipsen SA	37.295	0,04
1.000	Kering SA	484.250	0,52
2.944	Klepierre SA (REIT)	52.212	0,06
801	La Francaise des Jeux SAEM '144A'	21.995	0,02
2.968	Legrand SA	200.696	0,22
3.131	L'Oreal SA	894.527	0,96
3.514	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1.372.217	1,48
11.539	Natixis SA	26.828	0,03
31.397	Orange SA	334.221	0,36
678	Orpea	69.766	0,08
2.771	Pernod Ricard SA	388.079	0,42
6.915	Peugeot SA	100.129	0,11
3.316	Publicis Groupe SA	95.534	0,10
275	Remy Cointreau SA	33.330	0,04
2.605	Renault SA	58.821	0,06
3.493	Rexel SA	35.524	0,04
1.104	Rubis SCA	47.229	0,05
14.810	Sanofi	1.342.526	1,45
323	Sartorius Stedim Biotech	72.675	0,08
7.160	Schneider Electric SE	707.981	0,76
1.923	SCOR SE	46.921	0,05
271	SEB SA	39.864	0,04
9.059	Societe Generale SA	134.073	0,14
1.473	Sodexo SA	88.675	0,10

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Frankreich (Fortsetzung)</b>			
200	Sopra Steria Group	21.940	0,02
1.421	SPIE SA	18.899	0,02
4.468	Suez SA	46.624	0,05
675	Teleperformance	152.483	0,16
1.233	Ubisoft Entertainment SA	90.502	0,10
1.564	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	78.450	0,08
3.002	Valeo SA	70.127	0,08
5.957	Veolia Environnement SA	119.259	0,13
6.866	Vinci SA	563.012	0,61
10.933	Vivendi SA	249.710	0,27
206	Wendel SE	17.479	0,02
2.097	Worldline SA/France '144A'	161.637	0,17
	<b>Frankreich insgesamt</b>	<b>14.143.261</b>	<b>15,21</b>
<b>Deutschland</b>			
2.399	adidas AG	560.406	0,60
5.398	Allianz SE	981.140	1,06
2.026	alstria office REIT-AG (REIT)	26.865	0,03
11.903	BASF SE	593.722	0,64
13.077	Bayer AG	860.336	0,93
4.626	Bayerische Motoren Werke AG	262.849	0,28
413	Bechtle AG	64.841	0,07
1.313	Beiersdorf AG	132.744	0,14
2.449	Brenntag AG	114.540	0,12
750	CANCOM SE	35.400	0,04
426	Carl Zeiss Meditec AG	36.977	0,04
14.395	Commerzbank AG	57.105	0,06
1.595	Continental AG	139.020	0,15

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (Fortsetzung)</b>			
3.278	Covestro AG '144A'	110.960	0,12
665	CTS Eventim AG & Co KGaA	24.605	0,03
11.524	Daimler AG	416.535	0,45
1.817	Delivery Hero SE '144A'	165.274	0,18
21.697	Deutsche Bank AG	183.643	0,20
2.508	Deutsche Boerse AG	403.913	0,43
6.822	Deutsche Lufthansa AG	61.002	0,07
13.189	Deutsche Post AG	429.302	0,46
43.032	Deutsche Telekom AG	643.113	0,69
4.840	Deutsche Wohnen SE	193.358	0,21
27.359	E.ON SE	274.000	0,30
2.119	Evonik Industries AG	47.911	0,05
2.015	Evotec SE	48.763	0,05
467	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	18.129	0,02
1.215	Freenet AG	17.399	0,02
2.776	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	211.809	0,23
5.518	Fresenius SE & Co KGaA	243.454	0,26
775	FUCHS PETROLUB SE - Preference	27.699	0,03
1.519	GEA Group AG	42.760	0,05
613	Gerresheimer AG	50.327	0,05
388	GRENKE AG	26.617	0,03
631	Hannover Rueck SE	96.795	0,10
1.915	HelloFresh SE	90.771	0,10
2.314	Henkel AG & Co KGaA - Preference	191.784	0,21
291	HOCHTIEF AG	22.974	0,02
18.070	Infineon Technologies AG	377.211	0,41
815	KION Group AG	44.662	0,05
560	Knorr-Bremse AG	50.529	0,05



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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Deutschland (Fortsetzung)</b>			
978	LANXESS AG	45.927	0,05
892	LEG Immobilien AG	100.796	0,11
2.100	Merck KGaA	216.930	0,23
384	MorphoSys AG	43.181	0,05
580	MTU Aero Engines AG	89.407	0,10
1.854	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	429.016	0,46
724	Nemetschek SE	44.309	0,05
1.806	Porsche Automobil Holding SE - Preference	92.395	0,10
2.277	ProSiebenSat.1 Media SE	24.113	0,03
1.101	Puma SE	75.771	0,08
37	Rational AG	18.441	0,02
514	Rheinmetall AG	39.681	0,04
14.050	SAP SE	1.746.696	1,88
488	Sartorius AG - Preference	142.789	0,15
979	Scout24 AG '144A'	67.600	0,07
10.245	Siemens AG	1.073.266	1,16
1.934	Siemens Healthineers AG '144A'	82.485	0,09
1.514	Symrise AG - Class A	156.699	0,17
1.195	TAG Immobilien AG	25.358	0,03
1.038	TeamViewer AG '144A'	50.447	0,05
6.081	Telefonica Deutschland Holding AG	15.975	0,02
5.676	thyssenkrupp AG	35.838	0,04
5.938	TUI AG	24.882	0,03
843	Uniper SE	24.194	0,03
1.228	United Internet AG	46.308	0,05
7.192	Vonovia SE	392.539	0,42
2.174	Zalando SE '144A'	136.484	0,15
<b>Deutschland insgesamt</b>		<b>13.622.771</b>	<b>14,69</b>

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Irland</b>			
1.094	DCC Plc	80.996	0,09
2.064	Flutter Entertainment Plc	241.488	0,26
2.137	Glanbia Plc	21.541	0,02
1.989	Kerry Group Plc	219.387	0,24
1.577	Kingspan Group Plc	90.441	0,10
7.024	Linde Plc	1.321.917	1,42
11.960	Ryanair Holdings Plc	127.434	0,14
3.010	Smurfit Kappa Group Plc	89.578	0,10
2.422	UDG Healthcare Plc (Units)	19.131	0,02
<b>Irland insgesamt</b>		<b>2.211.913</b>	<b>2,39</b>
<b>Isle of Man</b>			
7.587	GVC Holdings Plc	61.814	0,07
<b>Isle of Man insgesamt</b>		<b>61.814</b>	<b>0,07</b>
<b>Italien</b>			
16.425	A2A SpA	20.704	0,02
1.643	Amplifon SpA	38.956	0,04
21.478	Assicurazioni Generali SpA	289.309	0,31
22.933	Banco BPM SpA	30.455	0,03
6.349	Davide Campari-Milano SpA	47.617	0,05
265	DiaSorin SpA	45.156	0,05
104.010	Enel SpA	798.589	0,86
7.879	FinecoBank Banca Fineco SpA	94.666	0,10
11.782	Hera SpA	39.423	0,04
888	Interpump Group SpA	23.479	0,03
227.428	Intesa Sanpaolo SpA	387.446	0,42
5.327	Italgas SpA	27.541	0,03

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Italien (Fortsetzung)</b>			
5.824	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	37.215	0,04
2.467	Moncler SpA	83.977	0,09
3.957	Nexi SpA '144A'	60.938	0,07
6.046	Poste Italiane SpA '144A'	46.796	0,05
2.770	Prysmian SpA	57.117	0,06
1.188	Recordati SpA	52.807	0,06
22.360	Snam SpA	96.908	0,10
134.981	Telecom Italia SpA/Milano	47.203	0,05
15.076	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	92.235	0,10
24.828	UniCredit SpA	203.292	0,22
14.252	Unione di Banche Italiane SpA	41.473	0,04
<b>Italien insgesamt</b>		<b>2.663.302</b>	<b>2,86</b>
<b>Jersey</b>			
20.283	Centamin Plc	40.923	0,04
12.330	Experian Plc	382.376	0,41
2.615	Ferguson Plc	190.211	0,20
153.445	Glencore Plc	289.028	0,31
10.054	IWG Plc	29.310	0,03
20.968	Man Group Plc/Jersey	30.137	0,03
3.271	Polymetal International Plc	58.133	0,06
18.647	WPP Plc	129.400	0,14
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>1.149.518</b>	<b>1,22</b>
<b>Luxemburg</b>			
19.915	Aroundtown SA	101.527	0,11
9.154	B&M European Value Retail SA	40.029	0,04
148	Eurofins Scientific SE	82.673	0,09

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Luxemburg (Fortsetzung)</b>			
1.930	Grand City Properties SA	39.642	0,04
4.263	SES SA Receipt - Class A	25.919	0,03
5.950	Tenaris SA	34.201	0,04
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>323.991</b>	<b>0,35</b>
<b>Niederlande</b>			
1.148	Aalberts NV	33.510	0,04
5.726	ABN AMRO Bank NV Dutch Cert '144A'	43.896	0,05
298	Adyen NV '144A'	386.059	0,42
18.299	Aegon NV	48.547	0,05
2.641	Akzo Nobel NV	210.593	0,23
6.106	Altice Europe NV	20.974	0,02
546	Argenx SE	108.272	0,12
665	ASM International NV	91.471	0,10
5.566	ASML Holding NV	1.819.525	1,96
1.997	ASR Nederland NV	54.598	0,06
916	BE Semiconductor Industries NV	36.319	0,04
12.299	CNH Industrial NV	76.598	0,08
737	Euronext NV '144A'	65.777	0,07
958	EXOR NV	48.705	0,05
1.789	Ferrari NV	271.660	0,29
11.134	Fiat Chrysler Automobiles NV	99.582	0,11
1.027	Heineken Holding NV	74.817	0,08
3.289	Heineken NV	269.895	0,29
676	IMCD NV	56.568	0,06
53.984	ING Groep NV	334.593	0,36
1.398	Just Eat Takeaway.com NV '144A'	129.678	0,14
14.582	Koninklijke Ahold Delhaize NV	353.759	0,38

## L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF\*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Niederlande (Fortsetzung)</b>			
2.054	Koninklijke DSM NV	253.053	0,27
39.345	Koninklijke KPN NV	92.854	0,10
12.068	Koninklijke Philips NV	501.063	0,54
791	Koninklijke Vopak NV	37.240	0,04
3.319	NN Group NV	99.238	0,11
5.545	Prosus NV	458.793	0,49
2.410	QIAGEN NV	92.399	0,10
1.190	Randstad NV	47.195	0,05
1.773	Signify NV '144A'	40.761	0,04
7.626	STMicroelectronics NV	184.702	0,20
19.119	Unilever NV	903.373	0,97
3.750	Wolters Kluwer NV	260.700	0,28
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>7.606.767</b>	<b>8,19</b>
<b>Norwegen</b>			
3.962	Adevinta ASA	35.432	0,04
14.030	DNB ASA	164.576	0,18
1.830	Entra ASA '144A'	20.740	0,02
1.798	Gjensidige Forsikring ASA	29.388	0,03
6.094	Mowi ASA	102.727	0,11
15.160	Norsk Hydro ASA	37.175	0,04
8.849	Orkla ASA	68.847	0,07
629	Salmar ASA	26.651	0,03
330	Schibsted ASA	7.638	0,01
7.620	Storebrand ASA	34.889	0,04
9.576	Telenor ASA	123.818	0,13
1.584	TGS NOPEC Geophysical Co ASA	20.372	0,02
2.022	TOMRA Systems ASA	65.893	0,07
<b>Norwegen insgesamt</b>		<b>738.146</b>	<b>0,79</b>

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF\*

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Polen</b>			
1.885	Bank Polska Kasa Opieki SA	22.843	0,02
902	CD Projekt SA	80.173	0,09
1.356	KGHM Polska Miedz SA	27.743	0,03
12	LPP SA	16.233	0,02
3.718	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	52.403	0,06
10.117	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	52.191	0,06
6.856	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	44.643	0,05
	<b>Polen insgesamt</b>	<b>296.229</b>	<b>0,33</b>
<b>Portugal</b>			
35.464	EDP - Energias de Portugal SA	150.722	0,16
4.719	Jeronimo Martins SGPS SA	73.546	0,08
	<b>Portugal insgesamt</b>	<b>224.268</b>	<b>0,24</b>
<b>Südafrika</b>			
57.976	Old Mutual Ltd	35.767	0,04
	<b>Südafrika insgesamt</b>	<b>35.767</b>	<b>0,04</b>
<b>Spanien</b>			
260	Acciona SA	22.659	0,02
3.545	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	79.550	0,09
916	Aena SME SA '144A'	108.729	0,12
6.093	Amadeus IT Group SA	282.593	0,30
94.195	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	288.613	0,31
75.341	Banco de Sabadell SA	23.288	0,03
208.983	Banco Santander SA	454.434	0,49
6.603	Bankinter SA	28.030	0,03
45.555	CaixaBank SA	86.577	0,09

## L&amp;G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF\*

## Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Spanien (Fortsetzung)</b>			
3.527	Cellnex Telecom SA '144A'	191.304	0,21
2.594	Enagas SA	56.420	0,06
5.667	Ferrovial SA	134.308	0,14
3.112	Grifols SA	84.117	0,09
83.672	Iberdrola SA	863.495	0,93
15.178	Industria de Diseno Textil SA	357.745	0,39
5.200	Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT)	40.768	0,04
22.135	International Consolidated Airlines Group SA	54.107	0,06
9.249	Mapfre SA	14.650	0,02
4.518	Merlin Properties Socimi SA (REIT)	33.343	0,04
3.556	Naturgy Energy Group SA	58.905	0,06
4.946	Red Electrica Corp SA	82.128	0,09
3.049	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	48.113	0,05
62.456	Telefonica SA	265.251	0,29
741	Viscofan SA	43.052	0,05
	<b>Spanien insgesamt</b>	<b>3.702.179</b>	<b>4,00</b>
<b>Schweden</b>			
2.053	AAK AB	31.411	0,03
1.093	AddTech AB	39.107	0,04
3.786	Alfa Laval AB	73.953	0,08
12.126	Assa Abloy AB	219.537	0,24
8.476	Atlas Copco AB	319.626	0,34
1.634	Axfood AB	31.761	0,03
2.720	BillerudKorsnas AB	34.688	0,04
3.254	Boliden AB	65.925	0,07
3.171	Castellum AB	52.743	0,06
4.176	Dometic Group AB '144A'	33.339	0,04

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (Fortsetzung)</b>			
2.254	Electrolux AB	33.560	0,04
4.830	Elekta AB	40.000	0,04
6.753	Epiroc AB	74.924	0,08
3.390	EQT AB	54.150	0,06
8.544	Essity AB	245.848	0,26
1.663	Evolution Gaming Group AB '144A'	88.298	0,10
3.726	Fabege AB	38.776	0,04
1.499	Fastighets AB Balder - Class B	50.868	0,05
2.764	Getinge AB	45.670	0,05
10.386	Hennes & Mauritz AB	133.991	0,14
3.752	Hexagon AB	195.055	0,21
4.031	Hexpol AB	26.580	0,03
1.212	Holmen AB	34.423	0,04
6.850	Husqvarna AB	49.947	0,05
1.038	ICA Gruppen AB	43.825	0,05
1.315	Industrivarden AB - Class A	26.566	0,03
1.329	Indutrade AB	46.738	0,05
2.359	Investment AB Latour	38.099	0,04
5.406	Investor AB	254.022	0,27
3.240	Kinnevik AB	75.890	0,08
931	L E Lundbergforetagen AB	37.617	0,04
719	Lifco AB	40.539	0,04
1.036	Loomis AB - Class B	22.038	0,02
3.804	Nibe Industrier AB	74.850	0,08
867	Saab AB	19.272	0,02
12.302	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	27.980	0,03
17.578	Sandvik AB	292.458	0,32
4.090	Securitas AB	49.072	0,05



## L&G Europe Equity (Responsible Exclusions) UCITS ETF\*

### Aufstellung der Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden (Fortsetzung)</b>			
546	Sinch AB '144A'	41.586	0,04
18.113	Skandinaviska Enskilda Banken AB	139.688	0,15
3.747	Skanska AB	67.856	0,07
5.540	SKF AB	91.670	0,10
8.719	Svenska Cellulosa AB SCA - Class B	92.321	0,10
24.982	Svenska Handelsbanken AB	211.140	0,23
1.179	Sweco AB	47.141	0,05
2.324	Swedish Orphan Biovitrum AB	47.794	0,05
5.492	Tele2 AB	64.844	0,07
39.643	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	326.413	0,35
28.814	Telia Co AB	95.825	0,10
2.238	Thule Group AB '144A'	50.303	0,05
3.287	Trelleborg AB	42.610	0,05
20.789	Volvo AB	289.857	0,31
3.167	Wallenstam AB	32.656	0,04
2.379	Wihlborgs Fastigheter AB	34.670	0,04
	<b>Schweden insgesamt</b>	<b>4.739.520</b>	<b>5,08</b>
<b>Schweiz</b>			
27.062	ABB Ltd	542.376	0,58
1.492	Adecco Group AG	62.329	0,07
6.756	Alcon Inc	345.079	0,37
97	Allreal Holding AG	17.098	0,02
435	Baloise Holding AG	58.081	0,06
583	Banque Cantonale Vaudoise	50.452	0,05
45	Barry Callebaut AG	76.405	0,08
6	Belimo Holding AG	39.295	0,04
213	Cembra Money Bank AG	18.523	0,02

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz (Fortsetzung)</b>			
1	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	76.485	0,08
7.114	Cie Financiere Richemont SA	404.006	0,44
2.908	Clariant AG	50.850	0,05
2.522	Coca-Cola HBC AG	56.266	0,06
29.305	Credit Suisse Group AG	269.792	0,29
69	EMS-Chemie Holding AG	47.588	0,05
220	Flughafen Zurich AG	25.447	0,03
664	Galenica AG '144A'	42.301	0,05
421	Geberit AG	187.583	0,20
32	Georg Fischer AG	24.460	0,03
112	Givaudan SA	371.275	0,40
256	Helvetia Holding AG	21.252	0,02
1.904	Idorsia Ltd	54.207	0,06
3.287	Julius Baer Group Ltd	122.459	0,13
866	Kuehne + Nagel International AG	128.077	0,14
1.908	Logitech International SA	110.902	0,12
1.036	Lonza Group AG	486.915	0,52
37.888	Nestle SA	3.728.754	4,01
27.625	Novartis AG	2.139.362	2,30
199	Partners Group Holding AG	160.693	0,17
488	PSP Swiss Property AG	48.925	0,05
9.207	Roche Holding AG	2.840.564	3,06
407	Schindler Holding AG	85.280	0,09
65	SGS SA	141.388	0,15
2.721	SIG Combibloc Group AG	39.194	0,04
1.470	Sika AG	251.868	0,27
773	Sonova Holding AG	137.384	0,15
102	Straumann Holding AG	78.014	0,08

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweiz (Fortsetzung)</b>			
193	Sunrise Communications Group AG '144A'	15.242	0,02
321	Swatch Group AG/The	57.036	0,06
366	Swiss Life Holding AG	120.708	0,13
1.225	Swiss Prime Site AG	100.830	0,11
4.070	Swiss Re AG	279.398	0,30
396	Swisscom AG	184.518	0,20
142	Tecan Group AG	44.777	0,05
679	Temenos AG	93.881	0,10
49.759	UBS Group AG	509.855	0,55
324	VAT Group AG '144A'	52.667	0,06
534	Vifor Pharma AG	71.525	0,08
2.120	Zurich Insurance Group AG	665.720	0,72
	<b>Schweiz insgesamt</b>	<b>15.537.086</b>	<b>16,71</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
14.770	3i Group Plc	135.285	0,15
2.071	Admiral Group Plc	52.378	0,06
15.253	Anglo American Plc	313.682	0,34
3.777	Antofagasta Plc	38.958	0,04
6.063	Ashmore Group Plc	27.827	0,03
6.147	Ashtead Group Plc	183.867	0,20
4.756	Associated British Foods Plc	100.194	0,11
42.038	Assura Plc (REIT)	36.303	0,04
16.643	AstraZeneca Plc	1.541.798	1,66
11.629	Auto Trader Group Plc '144A'	67.343	0,07
8.115	Avast Plc '144A'	47.181	0,05
836	AVEVA Group Plc	37.633	0,04
59.376	Aviva Plc	178.714	0,19

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
244.156	Barclays Plc	307.328	0,33
13.502	Barratt Developments Plc	73.659	0,08
6.739	Beazley Plc	30.396	0,03
1.632	Bellway Plc	45.710	0,05
1.255	Berkeley Group Holdings Plc	57.503	0,06
28.344	BHP Group Plc	515.862	0,56
9.023	British Land Co Plc/The (REIT)	38.355	0,04
3.409	Britvic Plc	28.877	0,03
94.997	BT Group Plc	119.189	0,13
5.151	Bunzl Plc	122.739	0,13
6.443	Burberry Group Plc	113.372	0,12
2.289	Carnival Plc	24.824	0,03
77.009	Centrica Plc	32.650	0,04
1.479	Close Brothers Group Plc	17.979	0,02
24.714	Compass Group Plc	302.329	0,33
19.493	ConvaTec Group Plc '144A'	41.945	0,05
897	Cranswick Plc	35.702	0,04
1.858	Croda International Plc	107.432	0,12
1.090	Dechra Pharmaceuticals Plc	34.127	0,04
820	Derwent London Plc (REIT)	25.042	0,03
31.185	Diageo Plc	919.932	0,99
874	Dialog Semiconductor Plc	35.493	0,04
1.208	Diploma Plc	23.854	0,03
15.951	Direct Line Insurance Group Plc	47.554	0,05
16.547	DS Smith Plc	59.743	0,06
4.902	Electrocomponents Plc	36.185	0,04
401	Games Workshop Group Plc	35.357	0,04
510	Genus Plc	19.816	0,02

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
65.830	GlaxoSmithKline Plc	1.185.219	1,28
13.483	Grainger Plc	42.421	0,05
2.344	Great Portland Estates Plc (REIT)	16.297	0,02
1.137	Greggs Plc	20.263	0,02
5.134	Halma Plc	130.071	0,14
3.370	Hargreaves Lansdown Plc	60.374	0,07
17.206	Hays Plc	22.525	0,02
1.507	Hikma Pharmaceuticals Plc	36.804	0,04
4.817	HomeServe Plc	69.154	0,07
12.372	Howden Joinery Group Plc	75.239	0,08
270.536	HSBC Holdings Plc	1.126.777	1,21
4.274	IG Group Holdings Plc	38.461	0,04
3.006	IMI Plc	30.506	0,03
2.836	Inchcape Plc	15.287	0,02
22.069	Informa Plc	114.204	0,12
2.215	InterContinental Hotels Group Plc	86.918	0,09
3.700	Intermediate Capital Group Plc	52.467	0,06
1.710	Intertek Group Plc	102.336	0,11
40.037	ITV Plc	32.893	0,04
24.177	J Sainsbury Plc	55.508	0,06
5.525	JD Sports Fashion Plc	37.818	0,04
2.369	Johnson Matthey Plc	54.677	0,06
26.344	Kingfisher Plc	63.990	0,07
7.506	Land Securities Group Plc (REIT)	45.663	0,05
69.172	Legal & General Group Plc	168.096	0,18
939.067	Lloyds Banking Group Plc	322.059	0,35
4.670	London Stock Exchange Group Plc	429.389	0,46
32.520	M&G Plc	59.941	0,06

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
24.134	Marks & Spencer Group Plc	26.284	0,03
14.135	Meggitt Plc	45.763	0,05
53.975	Melrose Industries Plc	67.691	0,07
4.575	Micro Focus International Plc	21.742	0,02
6.349	Mondi Plc	105.501	0,11
6.226	Moneysupermarket.com Group Plc	22.164	0,02
47.212	National Grid Plc	513.770	0,55
5.505	Network International Holdings Plc '144A'	26.707	0,03
1.849	Next Plc	99.548	0,11
2.402	NMC Health Plc**	24.797	0,03
5.433	Ocado Group Plc	121.210	0,13
9.734	Pearson Plc	61.659	0,07
5.827	Pennon Group Plc	71.731	0,08
4.044	Persimmon Plc	101.700	0,11
8.181	Phoenix Group Holdings Plc	57.959	0,06
35.264	Prudential Plc	472.704	0,51
25.359	Quilter Plc '144A'	38.819	0,04
9.321	Reckitt Benckiser Group Plc	762.080	0,82
4.018	Redrow Plc	19.042	0,02
26.116	RELX Plc	537.255	0,58
19.425	Rentokil Initial Plc	108.899	0,12
14.304	Rightmove Plc	85.918	0,09
14.125	Rio Tinto Plc	706.865	0,76
21.127	Rolls-Royce Holdings Plc	66.332	0,07
10.010	Rotork Plc	30.834	0,03
47.798	Royal Bank of Scotland Group Plc	63.940	0,07
11.911	Royal Mail Plc	23.881	0,03
11.261	RSA Insurance Group Plc	50.767	0,05

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
12.261	Sage Group Plc/The	90.615	0,10
1.615	Schroders Plc	52.394	0,06
12.199	Segro Plc (REIT)	120.110	0,13
3.101	Severn Trent Plc	84.569	0,09
11.335	Signature Aviation Plc	28.917	0,03
12.192	Smith & Nephew Plc	201.924	0,22
8.255	Smiths Group Plc	128.228	0,14
1.324	Spectris Plc	36.777	0,04
842	Spirax-Sarco Engineering Plc	92.406	0,10
12.111	SSE Plc	181.797	0,20
6.010	St James's Place Plc	62.995	0,07
45.542	Standard Chartered Plc	220.493	0,24
25.773	Standard Life Aberdeen Plc	75.872	0,08
4.128	Tate & Lyle Plc	30.317	0,03
44.132	Taylor Wimpey Plc	69.232	0,07
5.867	TechnipFMC Plc	35.941	0,04
122.300	Tesco Plc	306.891	0,33
5.433	TP ICAP Plc	20.967	0,02
6.578	Trainline Plc '144A'	31.435	0,03
3.347	Travis Perkins Plc	41.441	0,04
34.057	Tritax Big Box REIT Plc (REIT)	54.326	0,06
14.672	Unilever Plc	702.926	0,76
4.920	UNITE Group Plc/The (REIT)	50.877	0,05
7.739	United Utilities Group Plc	77.491	0,08
546	Victrex Plc	11.743	0,01
3.122	Vistry Group Plc	24.402	0,03
356.916	Vodafone Group Plc	505.960	0,54

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert €	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)</b>			
3.364	Weir Group Plc/The	39.357	0,04
2.523	Whitbread Plc	61.673	0,07
26.922	Wm Morrison Supermarkets Plc	56.435	0,06
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>18.343.547</b>	<b>19,77</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>92.770.636</b>	<b>99,86</b>
<b>Gesamtanlagen</b>			
Stammaktien		92.770.636	99,86
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		128.258	0,14
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>92.898.894</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,85
Sonstige Vermögenswerte			0,15
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

\* Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

\*\* Der Handel dieses Wertpapiers wurde ausgesetzt.



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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien</b>			
<b>Bermuda</b>			
9.347	Arch Capital Group Ltd	267.792	0,04
8.965	IHS Markit Ltd	676.857	0,11
15.875	Marvell Technology Group Ltd	556.577	0,09
	<b>Bermuda insgesamt</b>	<b>1.501.226</b>	<b>0,24</b>
<b>Cayman-Inseln</b>			
7.684	Sea Ltd ADR	824.032	0,14
	<b>Cayman-Inseln insgesamt</b>	<b>824.032</b>	<b>0,14</b>
<b>Curacao</b>			
33.857	Schlumberger Ltd	622.630	0,10
	<b>Curacao insgesamt</b>	<b>622.630</b>	<b>0,10</b>
<b>Irland</b>			
16.463	Accenture Plc - Class A	3.534.935	0,59
5.619	Aon Plc	1.082.219	0,18
10.008	Eaton Corp Plc	875.500	0,15
4.839	Horizon Therapeutics Plc	268.952	0,04
19.104	Johnson Controls International plc	652.211	0,11
13.007	Linde Plc	2.758.915	0,46
33.199	Medtronic Plc	3.044.348	0,51
6.130	Seagate Technology Plc	296.753	0,05
1.962	STERIS Plc	301.049	0,05
6.081	Trane Technologies Plc	541.087	0,09
3.094	Willis Towers Watson Plc	609.363	0,10
	<b>Irland insgesamt</b>	<b>13.965.332</b>	<b>2,33</b>

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Jersey</b>			
39.162	Amcor Plc	399.844	0,07
6.116	Aptiv Plc	476.559	0,08
<b>Jersey insgesamt</b>		<b>876.403</b>	<b>0,15</b>
<b>Liberia</b>			
4.141	Royal Caribbean Cruises Ltd	208.292	0,03
<b>Liberia insgesamt</b>		<b>208.292</b>	<b>0,03</b>
<b>Luxemburg</b>			
3.303	Spotify Technology SA	852.802	0,14
<b>Luxemburg insgesamt</b>		<b>852.802</b>	<b>0,14</b>
<b>Niederlande</b>			
6.172	LyondellBasell Industries NV	405.624	0,07
5.591	QIAGEN NV	239.351	0,04
<b>Niederlande insgesamt</b>		<b>644.975</b>	<b>0,11</b>
<b>Schweiz</b>			
11.314	Chubb Ltd	1.432.579	0,24
3.407	Garmin Ltd	332.183	0,05
8.084	TE Connectivity Ltd	659.250	0,11
<b>Schweiz insgesamt</b>		<b>2.424.012</b>	<b>0,40</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>			
3.001	Atlassian Corp Plc	540.990	0,09
<b>Vereinigtes Königreich insgesamt</b>		<b>540.990</b>	<b>0,09</b>

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten</b>			
14.205	3M Co	2.215.838	0,37
43.519	Abbott Laboratories	3.978.942	0,66
43.706	AbbVie Inc	4.291.055	0,71
1.123	ABIOMED Inc	271.272	0,04
18.898	Activision Blizzard Inc	1.434.358	0,24
11.915	Adobe Inc	5.186.719	0,86
1.816	Advance Auto Parts Inc	258.689	0,04
29.096	Advanced Micro Devices Inc	1.530.741	0,25
16.209	Aflac Inc	584.010	0,10
7.540	Agilent Technologies Inc	666.310	0,11
3.843	Akamai Technologies Inc	411.547	0,07
3.221	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	522.607	0,09
5.472	Alexion Pharmaceuticals Inc	614.177	0,10
1.844	Align Technology Inc	506.067	0,08
7.699	Allstate Corp/The	746.726	0,12
2.764	Alnylam Pharmaceuticals Inc	409.376	0,07
7.837	Alphabet Inc	11.078.462	1,84
7.050	Altice USA Inc	158.907	0,03
10.534	Amazon.com Inc	29.061.410	4,82
19.783	American Express Co	1.883.342	0,31
20.995	American International Group Inc	654.624	0,11
11.015	American Tower Corp (REIT)	2.847.818	0,47
4.189	American Water Works Co Inc	538.957	0,09
3.055	Ameriprise Financial Inc	458.372	0,08
3.546	AmerisourceBergen Corp - Class A	357.330	0,06
5.552	AMETEK Inc	496.182	0,08
14.605	Amgen Inc	3.444.735	0,57
7.192	Amphenol Corp - Class A	689.066	0,11

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
9.248	Analog Devices Inc	1.134.175	0,19
2.068	ANSYS Inc	603.298	0,10
6.294	Anthem Inc	1.655.196	0,27
5.183	Apollo Global Management Inc - Class A	258.735	0,04
107.808	Apple Inc	39.328.358	6,53
23.102	Applied Materials Inc	1.396.516	0,23
13.428	Archer-Daniels-Midland Co	535.777	0,09
1.322	Arista Networks Inc	277.660	0,05
4.389	Arthur J Gallagher & Co	427.884	0,07
177.257	AT&T Inc	5.358.479	0,89
3.024	Atmos Energy Corp	301.130	0,05
5.449	Autodesk Inc	1.303.346	0,22
10.742	Automatic Data Processing Inc	1.599.376	0,27
561	AutoZone Inc	632.875	0,10
3.391	AvalonBay Communities Inc (REIT)	524.384	0,09
1.425	Avangrid Inc	59.822	0,01
11.488	Avantor Inc	195.296	0,03
15.659	Baker Hughes Co - Class A	240.992	0,04
8.061	Ball Corp	560.159	0,09
216.312	Bank of America Corp	5.137.410	0,85
21.406	Bank of New York Mellon Corp/The	827.342	0,14
12.667	Baxter International Inc	1.090.629	0,18
7.199	Becton Dickinson and Co	1.722.505	0,29
34.538	Berkshire Hathaway Inc - Class B	6.165.378	1,02
5.444	Best Buy Co Inc	475.098	0,08
4.120	Biogen Inc	1.102.306	0,18
4.438	BioMarin Pharmaceutical Inc	547.383	0,09
535	Bio-Rad Laboratories Inc	241.547	0,04
970	Bio-Techne Corp	256.148	0,04

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
3.384	Black Knight Inc	245.543	0,04
16.731	Blackstone Group Inc/The	947.978	0,16
1.017	Booking Holdings Inc	1.619.410	0,27
3.283	Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A	255.385	0,04
3.940	Boston Properties Inc (REIT)	356.097	0,06
36.076	Boston Scientific Corp	1.266.628	0,21
56.196	Bristol-Myers Squibb Co	3.304.325	0,55
9.714	Broadcom Inc	3.065.836	0,51
2.755	Broadridge Financial Solutions Inc	347.653	0,06
5.608	Brown & Brown Inc	228.582	0,04
1.367	Brown-Forman Corp	78.698	0,01
1.578	Burlington Stores Inc	310.756	0,05
137	Cable One Inc	243.154	0,04
6.668	Cadence Design Systems Inc	639.861	0,11
3.922	Campbell Soup Co	194.649	0,03
11.063	Capital One Financial Corp	692.433	0,11
7.062	Cardinal Health Inc	368.566	0,06
5.586	Carlyle Group Inc/The (Units)	155.849	0,03
3.946	CarMax Inc	353.364	0,06
3.941	Catalent Inc	288.875	0,05
13.492	Caterpillar Inc	1.706.738	0,28
2.564	Cboe Global Markets Inc	239.170	0,04
8.082	CBRE Group Inc - Class A	365.468	0,06
3.358	CDW Corp/DE	390.132	0,06
2.865	Celanese Corp - Class A	247.364	0,04
14.095	Centene Corp	895.737	0,15
26.111	CenturyLink Inc	261.893	0,04
3.357	Ceridian HCM Holding Inc	266.109	0,04
7.447	Cerner Corp	510.492	0,08

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
3.314	CH Robinson Worldwide Inc	262.005	0,04
28.998	Charles Schwab Corp/The	978.393	0,16
3.547	Charter Communications Inc	1.809.112	0,30
5.905	Cheniere Energy Inc	285.330	0,05
703	Chipotle Mexican Grill Inc - Class A	739.809	0,12
6.083	Church & Dwight Co Inc	470.216	0,08
9.197	Cigna Corp	1.725.817	0,29
3.863	Cincinnati Financial Corp	247.348	0,04
2.281	Cintas Corp	607.567	0,10
105.197	Cisco Systems Inc	4.906.388	0,81
51.547	Citigroup Inc	2.634.052	0,44
10.434	Citizens Financial Group Inc	263.354	0,04
3.040	Citrix Systems Inc	449.646	0,07
3.119	Clorox Co/The	684.215	0,11
8.756	CME Group Inc	1.423.200	0,24
6.898	CMS Energy Corp	402.981	0,07
106.152	Coca-Cola Co/The	4.742.871	0,79
4.297	Cognex Corp	256.617	0,04
13.504	Cognizant Technology Solutions Corp	767.297	0,13
21.283	Colgate-Palmolive Co	1.559.193	0,26
111.954	Comcast Corp	4.363.967	0,72
12.073	Conagra Brands Inc	424.607	0,07
8.105	Consolidated Edison Inc	582.993	0,10
3.754	Constellation Brands Inc - Class A	656.762	0,11
1.293	Cooper Cos Inc/The	366.747	0,06
5.358	Copart Inc	446.161	0,07
18.126	Corning Inc	469.463	0,08
18.369	Corteva Inc	492.106	0,08
988	CoStar Group Inc	702.142	0,12

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
10.926	Costco Wholesale Corp	3.312.872	0,55
1.671	Coupa Software Inc	462.934	0,08
3.655	Crowdstrike Holdings Inc	366.560	0,06
10.403	Crown Castle International Corp (REIT)	1.740.942	0,29
19.085	CSX Corp	1.330.988	0,22
3.677	Cummins Inc	637.077	0,11
32.668	CVS Health Corp	2.122.440	0,35
15.612	Danaher Corp	2.760.670	0,46
2.950	Darden Restaurants Inc	223.521	0,04
4.238	Datadog Inc	368.494	0,06
2.981	DaVita Inc	235.916	0,04
7.868	Deere & Co	1.236.456	0,21
6.606	Dell Technologies Inc	362.934	0,06
15.411	Delta Air Lines Inc	432.279	0,07
5.181	DENTSPLY SIRONA Inc	228.275	0,04
2.343	DexCom Inc	949.852	0,16
6.722	Digital Realty Trust Inc (REIT)	955.263	0,16
7.421	Discover Financial Services	371.718	0,06
4.368	Discovery Inc	92.165	0,02
4.294	DocuSign Inc - Class A	739.470	0,12
6.256	Dollar General Corp	1.191.831	0,20
5.852	Dollar Tree Inc	542.363	0,09
20.748	Dominion Energy Inc	1.684.323	0,28
961	Domino's Pizza Inc	355.032	0,06
3.429	Dover Corp	331.104	0,05
18.954	Dow Inc	772.565	0,13
8.375	DR Horton Inc	464.394	0,08
4.713	DTE Energy Co	506.648	0,08
18.373	Duke Energy Corp	1.467.819	0,24

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
9.000	Duke Realty Corp (REIT)	318.510	0,05
17.939	DuPont de Nemours Inc	953.099	0,16
3.303	Dynatrace Inc	134.102	0,02
5.291	E*TRADE Financial Corp	263.121	0,04
16.679	eBay Inc	874.814	0,14
7.210	Ecolab Inc	1.434.430	0,24
9.657	Edison International	524.472	0,09
5.327	Edwards Lifesciences Corp	368.149	0,06
7.153	Electronic Arts Inc	944.554	0,16
23.726	Eli Lilly and Co	3.895.335	0,65
15.073	Emerson Electric Co	934.978	0,15
4.815	Entergy Corp	451.695	0,07
1.289	EPAM Systems Inc	324.841	0,05
2.207	Equinix Inc (REIT)	1.549.976	0,26
4.113	Equity LifeStyle Properties Inc (REIT)	256.980	0,04
8.963	Equity Residential (REIT)	527.204	0,09
6.422	Essential Utilities Inc	271.265	0,04
1.567	Essex Property Trust Inc (REIT)	359.109	0,06
5.370	Estee Lauder Cos Inc/The - Class A	1.013.212	0,17
3.004	Etsy Inc	319.115	0,05
8.454	Eversource Energy	703.965	0,12
3.515	Exact Sciences Corp	305.594	0,05
24.678	Exelon Corp	895.565	0,15
2.858	Expedia Group Inc	234.928	0,04
4.000	Expeditors International of Washington Inc	304.160	0,05
2.981	Extra Space Storage Inc (REIT)	275.355	0,05
59.409	Facebook Inc - Class A	13.490.002	2,24
918	FactSet Research Systems Inc	301.535	0,05
666	Fair Isaac Corp	278.415	0,05



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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
13.758	Fastenal Co	589.393	0,10
6.019	FedEx Corp	843.984	0,14
15.302	Fidelity National Information Services Inc	2.051.845	0,34
17.355	Fifth Third Bancorp	334.604	0,06
4.051	First Republic Bank/CA	429.365	0,07
13.825	Fiserv Inc	1.349.597	0,22
2.058	FleetCor Technologies Inc	517.649	0,09
3.123	FMC Corp	311.113	0,05
93.226	Ford Motor Co	566.814	0,09
3.302	Fortinet Inc	453.266	0,08
7.920	Fortive Corp	535.867	0,09
4.427	Fox Corp	118.821	0,02
2.106	Gartner Inc	255.521	0,04
219.856	General Electric Co	1.501.616	0,25
15.002	General Mills Inc	924.873	0,15
33.697	General Motors Co	852.534	0,14
3.472	Genuine Parts Co	301.925	0,05
30.977	Gilead Sciences Inc	2.383.370	0,40
7.479	Global Payments Inc	1.268.588	0,21
4.145	GoDaddy Inc - Class A	303.953	0,05
8.597	Goldman Sachs Group Inc/The	1.698.939	0,28
21.383	Halliburton Co	277.551	0,05
8.697	Hartford Financial Services Group Inc/The	335.269	0,06
3.136	Hasbro Inc	235.043	0,04
6.792	HCA Healthcare Inc	659.232	0,11
14.375	Healthpeak Properties Inc (REIT)	396.175	0,07
1.238	HEICO Corp	123.367	0,02
3.661	Hershey Co/The	474.539	0,08

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
31.040	Hewlett Packard Enterprise Co	302.019	0,05
6.464	Hilton Worldwide Holdings Inc	474.781	0,08
6.219	Hologic Inc	354.483	0,06
26.700	Home Depot Inc/The	6.688.617	1,11
7.024	Hormel Foods Corp	339.048	0,06
36.202	HP Inc	631.001	0,10
3.308	Humana Inc	1.282.677	0,21
1.966	IAC/interactivecorp	635.804	0,11
1.808	IDEX Corp	285.736	0,05
2.071	IDEXX Laboratories Inc	683.761	0,11
7.842	Illinois Tool Works Inc	1.371.174	0,23
3.669	Illumina Inc	1.358.814	0,23
5.325	Incyte Corp	553.640	0,09
1.546	Insulet Corp	300.326	0,05
105.102	Intel Corp	6.288.253	1,04
13.353	Intercontinental Exchange Inc	1.223.135	0,20
22.084	International Business Machines Corp	2.667.085	0,44
2.543	International Flavors & Fragrances Inc	311.416	0,05
9.571	International Paper Co	336.995	0,06
6.274	Intuit Inc	1.858.296	0,31
2.903	Intuitive Surgical Inc	1.654.216	0,27
14.579	Invitation Homes Inc (REIT)	401.360	0,07
4.756	IQVIA Holdings Inc	674.781	0,11
2.600	J M Smucker Co/The	275.106	0,05
1.821	Jack Henry & Associates Inc	335.119	0,06
1.972	JB Hunt Transport Services Inc	237.310	0,04
75.110	JPMorgan Chase & Co	7.064.847	1,17
2.293	Kansas City Southern	342.322	0,06

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
8.743	Kellogg Co	577.563	0,10
8.576	Keurig Dr Pepper Inc	243.558	0,04
23.926	KeyCorp	291.419	0,05
4.695	Keysight Technologies Inc	473.162	0,08
8.347	Kimberly-Clark Corp	1.179.848	0,20
48.492	Kinder Morgan Inc	735.624	0,12
13.279	KKR & Co Inc	410.056	0,07
3.836	KLA Corp	746.025	0,12
8.704	Kraft Heinz Co/The	277.571	0,05
19.482	Kroger Co/The	659.466	0,11
5.435	L3Harris Technologies Inc	922.156	0,15
2.369	Laboratory Corp of America Holdings	393.515	0,07
3.580	Lam Research Corp	1.157.987	0,19
8.067	Las Vegas Sands Corp	367.371	0,06
3.494	Leidos Holdings Inc	327.283	0,05
7.277	Lennar Corp	448.409	0,07
607	Liberty Broadband Corp	74.169	0,01
4.105	Live Nation Entertainment Inc	181.975	0,03
18.780	Lowe's Cos Inc	2.537.554	0,42
3.022	Lululemon Athletica Inc	942.894	0,16
3.157	M&T Bank Corp	328.233	0,05
15.595	Marathon Petroleum Corp	582.941	0,10
325	Markel Corp	300.030	0,05
874	MarketAxess Holdings Inc	437.804	0,07
7.007	Marriott International Inc/MD	600.710	0,10
12.795	Marsh & McLennan Cos Inc	1.373.799	0,23
6.775	Masco Corp	340.173	0,06
1.256	Masimo Corp	286.355	0,05

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
21.792	Mastercard Inc	6.443.894	1,07
6.672	Maxim Integrated Products Inc	404.390	0,07
3.035	McCormick & Co Inc/MD	544.509	0,09
18.368	McDonald's Corp	3.388.345	0,56
4.084	McKesson Corp	626.567	0,10
12.550	Medical Properties Trust Inc (REIT)	235.940	0,04
1.095	MercadoLibre Inc	1.079.418	0,18
62.805	Merck & Co Inc	4.856.711	0,81
19.050	MetLife Inc	695.706	0,12
572	Mettler-Toledo International Inc	460.775	0,08
6.141	Microchip Technology Inc	646.709	0,11
27.792	Micron Technology Inc	1.431.844	0,24
186.041	Microsoft Corp	37.861.204	6,28
2.680	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	307.316	0,05
7.754	Moderna Inc	497.884	0,08
1.524	Molina Healthcare Inc	271.242	0,04
35.999	Mondelez International Inc	1.840.629	0,31
1.292	MongoDB Inc	292.431	0,05
11.763	Monster Beverage Corp	815.411	0,14
4.731	Moody's Corp	1.299.748	0,22
30.215	Morgan Stanley	1.459.384	0,24
4.155	Motorola Solutions Inc	582.240	0,10
2.017	MSCI Inc - Class A	673.315	0,11
2.706	Nasdaq Inc	323.286	0,05
5.370	NetApp Inc	238.267	0,04
10.734	Netflix Inc	4.884.399	0,81
2.310	Neurocrine Biosciences Inc	281.820	0,05
19.849	Newmont Corp	1.225.477	0,20

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
12.174	NextEra Energy Inc	2.923.830	0,49
30.387	NIKE Inc	2.979.445	0,49
1.426	Nordson Corp	270.526	0,04
6.385	Norfolk Southern Corp	1.121.014	0,19
5.144	Northern Trust Corp	408.125	0,07
14.506	NortonLifeLock Inc	287.654	0,05
7.063	Nucor Corp	292.479	0,05
14.636	NVIDIA Corp	5.560.363	0,92
85	NVR Inc	276.994	0,05
2.896	Okta Inc	579.866	0,10
2.528	Old Dominion Freight Line Inc	428.724	0,07
4.989	Omnicom Group Inc	272.399	0,05
11.218	ONEOK Inc	372.662	0,06
49.854	Oracle Corp	2.755.431	0,46
1.771	O'Reilly Automotive Inc	746.778	0,12
8.358	PACCAR Inc	625.596	0,10
2.514	Packaging Corp of America	250.897	0,04
2.301	Palo Alto Networks Inc	528.471	0,09
3.185	Parker-Hannifin Corp	583.715	0,10
7.784	Paychex Inc	589.638	0,10
1.195	Paycom Software Inc	370.127	0,06
29.144	PayPal Holdings Inc	5.077.759	0,84
34.420	PepsiCo Inc	4.552.389	0,76
2.674	PerkinElmer Inc	262.293	0,04
138.315	Pfizer Inc	4.522.901	0,75
10.713	Phillips 66	770.265	0,13
10.337	PNC Financial Services Group Inc/The	1.087.556	0,18
988	Pool Corp	268.608	0,04

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
4.856	PPD Inc	130.141	0,02
6.056	PPG Industries Inc	642.299	0,11
6.744	Principal Financial Group Inc	280.146	0,05
61.533	Procter & Gamble Co/The	7.357.501	1,22
14.686	Progressive Corp/The	1.176.495	0,20
18.595	Prologis Inc (REIT)	1.735.471	0,29
9.750	Prudential Financial Inc	593.775	0,10
12.309	Public Service Enterprise Group Inc	605.110	0,10
3.812	Public Storage (REIT)	731.485	0,12
2.789	Qorvo Inc	308.268	0,05
27.931	QUALCOMM Inc	2.547.587	0,42
3.187	Quest Diagnostics Inc	363.191	0,06
8.274	Realty Income Corp (REIT)	492.303	0,08
2.668	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.663.898	0,28
23.436	Regions Financial Corp	260.608	0,04
8.068	Republic Services Inc - Class A	661.979	0,11
3.486	ResMed Inc	669.312	0,11
1.830	RingCentral Inc - Class A	521.568	0,09
2.823	Rockwell Automation Inc	601.299	0,10
2.540	Roku Inc	295.986	0,05
3.385	Rollins Inc	143.490	0,02
2.493	Roper Technologies Inc	967.932	0,16
8.550	Ross Stores Inc	728.802	0,12
3.273	RPM International Inc	245.671	0,04
6.016	S&P Global Inc	1.982.152	0,33
21.394	salesforce.com Inc	4.007.738	0,67
1.898	Sarepta Therapeutics Inc	304.325	0,05
2.795	SBA Communications Corp (REIT) - Class A	832.686	0,14

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
4.230	Seattle Genetics Inc	718.762	0,12
7.371	Sempra Energy	864.102	0,14
4.706	ServiceNow Inc	1.906.212	0,32
2.053	Sherwin-Williams Co/The	1.186.326	0,20
7.428	Simon Property Group Inc (REIT)	507.927	0,08
29.097	Sirius XM Holdings Inc	170.799	0,03
4.053	Skyworks Solutions Inc	518.217	0,09
10.760	Slack Technologies Inc	334.528	0,06
26.636	Southern Co/The (Units)	1.381.077	0,23
14.588	Southwest Airlines Co	498.618	0,08
4.010	Splunk Inc	796.787	0,13
8.979	Square Inc	942.256	0,16
5.292	SS&C Technologies Holdings Inc	298.892	0,05
4.020	Stanley Black & Decker Inc	560.308	0,09
29.232	Starbucks Corp	2.151.183	0,36
8.709	State Street Corp	553.457	0,09
8.777	Stryker Corp	1.581.528	0,26
2.504	Sun Communities Inc (REIT)	339.743	0,06
1.266	SVB Financial Group	272.861	0,05
14.516	Synchrony Financial	321.675	0,05
3.781	Synopsys Inc	737.295	0,12
12.323	Sysco Corp	673.575	0,11
2.797	Take-Two Interactive Software Inc	390.377	0,06
12.415	Target Corp	1.488.931	0,25
12.050	TD Ameritrade Holding Corp	438.379	0,07
1.855	Teladoc Health Inc	354.008	0,06
888	Teledyne Technologies Inc	276.124	0,05
1.111	Teleflex Inc	404.382	0,07

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
4.144	Teradyne Inc	350.209	0,06
3.660	Tesla Inc	3.952.105	0,66
22.881	Texas Instruments Inc	2.905.201	0,48
9.787	Thermo Fisher Scientific Inc	3.546.222	0,59
2.982	Tiffany & Co	363.625	0,06
30.230	TJX Cos Inc/The	1.528.429	0,25
18.002	T-Mobile US Inc	1.874.908	0,31
2.785	Tractor Supply Co	367.035	0,06
962	Trade Desk Inc/The - Class A	391.053	0,06
1.339	TransDigm Group Inc	591.905	0,10
4.595	TransUnion	399.949	0,07
6.106	Travelers Cos Inc/The	696.389	0,12
5.936	Trimble Inc	256.376	0,04
34.071	Truist Financial Corp	1.279.366	0,21
3.225	Twilio Inc - Class A	707.630	0,12
18.156	Twitter Inc	540.867	0,09
951	Tyler Technologies Inc	329.883	0,05
6.883	Tyson Foods Inc - Class A	410.984	0,07
40.420	Uber Technologies Inc	1.256.254	0,21
214	Ubiquiti Inc	37.356	0,01
6.981	UDR Inc (REIT)	260.950	0,04
1.326	Ulta Beauty Inc	269.735	0,04
16.829	Union Pacific Corp	2.845.279	0,47
17.503	United Parcel Service Inc - Class B	1.945.984	0,32
1.831	United Rentals Inc	272.892	0,05
23.389	UnitedHealth Group Inc	6.898.586	1,14
38.203	US Bancorp	1.406.634	0,23
10.119	Valero Energy Corp	595.200	0,10



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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
2.145	Varian Medical Systems Inc	262.805	0,04
3.368	Veeva Systems Inc - Class A	789.527	0,13
9.052	Ventas Inc (REIT)	331.484	0,05
2.820	VeriSign Inc	583.261	0,10
3.990	Verisk Analytics Inc - Class A	679.098	0,11
103.065	Verizon Communications Inc	5.681.973	0,94
6.378	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.851.597	0,31
8.963	VF Corp	546.205	0,09
13.104	ViacomCBS Inc - Class B	305.585	0,05
41.833	Visa Inc - Class A	8.080.881	1,34
12.401	Vistra Corp	230.907	0,04
2.009	VMware Inc	311.114	0,05
3.395	W R Berkley Corp	194.500	0,03
18.364	Walgreens Boots Alliance Inc	778.450	0,13
34.641	Walmart Inc	4.149.299	0,69
44.741	Walt Disney Co/The	4.989.069	0,83
10.274	Waste Management Inc	1.088.119	0,18
1.491	Waters Corp	268.976	0,04
1.585	Wayfair Inc	313.212	0,05
10.634	Welltower Inc (REIT)	550.309	0,09
1.802	West Pharmaceutical Services Inc	409.360	0,07
7.434	Western Digital Corp	328.211	0,05
4.459	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	256.705	0,04
18.504	Weyerhaeuser Co (REIT)	415.600	0,07
30.162	Williams Cos Inc/The	573.681	0,10
4.350	Workday Inc - Class A	815.016	0,14
4.151	WP Carey Inc (REIT)	280.815	0,05
1.194	WW Grainger Inc	375.107	0,06

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

Zum 30. Juni 2020

Nominal	Beschreibung	Wert US\$	% des Nettover- mögens
<b>Stammaktien (Fortsetzung)</b>			
<b>Vereinigte Staaten (Fortsetzung)</b>			
5.950	Xilinx Inc	585.420	0,10
4.339	Xylem Inc/NY	281.861	0,05
9.320	Yum China Holdings Inc	448.012	0,07
7.701	Yum! Brands Inc	669.294	0,11
1.327	Zebra Technologies Corp	339.646	0,06
2.927	Zendesk Inc	259.127	0,04
3.522	Zillow Group Inc	202.902	0,03
5.337	Zimmer Biomet Holdings Inc	637.024	0,11
11.822	Zoetis Inc	1.620.087	0,27
4.032	Zoom Video Communications Inc	1.022.273	0,17
1.831	Zscaler Inc	200.495	0,03
<b>Vereinigte Staaten insgesamt</b>		<b>579.746.843</b>	<b>96,23</b>
<b>Stammaktien insgesamt</b>		<b>602.207.537</b>	<b>99,96</b>
<b>Gesamtanlagen</b>		<b>Wert US\$</b>	<b>% des Nettover- mögens</b>
Stammaktien		602.207.537	99,96
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		231.270	0,04
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>		<b>602.438.807</b>	<b>100,00</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamt- vermö- gens</b>
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere			99,72
Sonstige Vermögenswerte			0,28
			<b>100,00</b>
Die Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens ist nach Anhang 12 der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben.			

\* Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

## OGAW-V-Vergütungspolitik (ungeprüft)

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Vergütungspolitik im Zusammenhang mit der Verwaltung der Gesellschaft umgesetzt, die mit den in der OGAW-Richtlinie dargelegten Vergütungsregelungen in Einklang steht (die „Vergütungsregelungen“). Die Vergütungspolitik ist mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und fördert dieses. Sie animiert nicht zum Eingehen von Risiken, die mit den Risikoprofilen, Vorschriften oder Satzungen der Gesellschaft und ihrer Fonds unvereinbar sind.

Die Vergütungsregelungen gelten für die Mitarbeiterkategorien, deren berufliche Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil der Gesellschaft auswirkt (die „identifizierten Mitarbeiter“). Zu den identifizierten Mitarbeitern zählen alle Mitarbeiter und anderes Personal, die bzw. das Entscheidungsträger, Fondsmanager und Personen sind/ist, die effektive Anlageentscheidungen treffen, Personen, die in der Lage sind, Einfluss auf diese Mitarbeiter oder dieses Personal auszuüben, u. a. Anlageberater und -analysten, Mitglieder der obersten Führungsspitze und Mitarbeiter, die eine Gesamtvergütung erhalten, durch die sie unter dieselbe Vergütungskategorie wie Mitglieder der obersten Führungsspitze und Entscheidungsträger fallen.

Während des Berichtszeitraums wurde jedem der unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder (d. h. Eimear Cowhey, Adrian Waters und Feargal Dempsey) ein festes Honorar von 32.500 €, 37.500 € bzw. 18.575 € in Bezug auf die für die Gesellschaft geleisteten Dienste gezahlt. Keines der unabhängigen nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder erhält eine variable Vergütung.

Herr Mark Weeks erhielt ein Honorar von 16.532 € (30. Juni 2019: 20.000 €) für die der Gesellschaft im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 erbrachten Dienste. Herr Weeks erhielt und erhält keine variable Vergütung.

Verwaltungsratsmitglieder, die gleichzeitig bei LGIMH beschäftigt sind (nämlich Siobhan Boylan und Jason Kennard), erhalten von der Gesellschaft oder der Verwaltungsgesellschaft weder eine feste noch eine variable Vergütung.

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

Kein Verwaltungsratsmitglied hatte oder hat Anspruch auf Pensionen von der Gesellschaft oder der Verwaltungsgesellschaft, und weder die Gesellschaft noch die Verwaltungsgesellschaft hat einem Verwaltungsratsmitglied Aktienoptionen oder langfristige Leistungsanreize gewährt.

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 hat sich die Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft nicht auf Bevollmächtigte der Verwaltungsgesellschaft erstreckt. Es gehört jedoch zu den Grundsätzen der Verwaltungsgesellschaft, sicherzustellen, dass die Vergütungsanforderungen, die an die Delegierten gestellt werden, die „ESMA-Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der OGAW-Richtlinie“ erfüllen oder übertreffen.

Die Verwaltungsgesellschaft hat festgelegt, dass im Hinblick auf die Größe, den internen Betrieb, die Art, den Umfang und die Komplexität der Verwaltungsgesellschaft kein Vergütungsausschuss erforderlich ist. Die Verwaltungsgesellschaft überprüft die Umsetzung der Vergütungspolitik jährlich.

Die allgemeinen Grundsätze der Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft und deren Umsetzung wurden vom Risikoüberwachungsausschuss überprüft, einem aus verschiedenen Mitarbeitern der Unternehmensgruppe L&G bestehenden Ausschuss. Diese üben Aufgaben der Risiko-, Innenrevision- und Compliance-Überwachung in Bezug auf das Geschäft der Verwaltungsgesellschaft aus (d. h. es handelt sich nicht um einen Ausschuss des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft).

## Value-at-Risk-Bericht („VaR“-Bericht) (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020

Fonds	Tracking-Index	Tatsächlicher Wert	Max. Wert	Wertüberprüfung
L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	LevDAX® x2 Index	2,00	2	Erfüllt
L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	ShortDAX® x2 Index	2,00	2	Erfüllt
L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	Bloomberg Commodity Index 3 Month Forward Total Return	1,00	2	Erfüllt
L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	FTSE 100® Daily Leveraged Index	2,00	2	Erfüllt
L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	FTSE 100® Daily Super Short Strategy Index	2,00	2	Erfüllt
L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	Russell 2000® Index	1,00	2	Erfüllt
L&G Gold Mining UCITS ETF	DAXglobal® Gold Miners (TR) USD	1,00	2	Erfüllt
L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF	Solactive US Energy Infrastructure MLP Index TR	1,02	2	Erfüllt
L&G All Commodities UCITS ETF	Bloomberg Commodity Index Total Return	1,00	2	Erfüllt
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	1,00	2	Erfüllt

Der relative VaR ist im Grunde der VaR des Nettoinventarwerts je Anteil des Fonds, dividiert durch den VaR seines nicht gehebelten Referenzindex. Der VaR des NIW je Anteil des Fonds darf das Zweifache des VaR des nicht gehebelten Referenzindex nicht übersteigen. Ein VaR von mehr als 2 wird als „nicht erfüllt“ angesehen und an die jeweils zuständige Behörde gemeldet. Da die Short-Inverse-Indizes und die Long-Leveraged-Indizes den -2-fachen bzw. den +2-fachen VaR des nicht gehebelten Referenzindex anwenden, zielen die Fonds effektiv auf den Grenzwert von 2 ab. Zuvor wurde der Wert auf 2 Dezimalstellen berichtet, wenn kein Verstoß vorlag; derzeit geben wir 4 Dezimalstellen an, wenn ein technischer Verstoß vorliegt. Deshalb beabsichtigen wir eine Reduzierung des gehebelten Swap-Engagements auf ca. 99,70 % bis 99,85 %. Dadurch wird der relative VaR im Zeitablauf knapp unter 2 gebracht, wenn die Daten für ein Jahr herangezogen werden. Zum Juli 2020 lagen keine Verstöße vor.

## Weitere Informationen (ungeprüft)

### Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions)

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 wurden vom Anlageverwalter im Namen der Gesellschaft keine Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen abgeschlossen.

### Wechselkurse

Zur Umrechnung der auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten per 30. Juni 2020 in US-Dollar wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2020
Australischer Dollar	1,4524
Kanadischer Dollar	1,3620
Chinesischer Yuan Renminbi	7,0741
Dänische Krone	6,6359
Euro	0,8903
Hongkong Dollar	7,7504
Israelischer Schekel	3,4610
Japanischer Yen	107,8850
Koreanischer Won	1.202,8498
Neuseeland-Dollar	1,5534
Norwegische Krone	9,6470
Britisches Pfund	0,8093
Singapur-Dollar	1,3950
Schwedische Krone	9,3166
Schweizer Franken	0,9476
Taiwanesischer Dollar	29,5045

Zur Umrechnung der auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten per 30. Juni 2020 in Euro wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2020
Australischer Dollar	1,6313
Dänische Krone	7,4533
Hongkong Dollar	8,7051
Norwegische Krone	10,8352
Britisches Pfund	0,9090
Schwedische Krone	10,4642
Schweizer Franken	1,0643
US-Dollar	1,1232

Zur Umrechnung der auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten per 30. Juni 2020 in GBP wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2020
Euro	1,1001
Norwegische Krone	11,9198
US-Dollar	1,2356

## Zusätzliche Informationen (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zur Umrechnung der auf Fremdwährung lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten per 30. Juni 2019 wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2019	30. Juni 2019	30. Juni 2019
	USD	EUR	GBP
Euro	0,8781	1,0000	1,1176
Britisches Pfund	0,7857	0,8948	1,0000
US-Dollar	1,0000	1,1388	1,2727

Zur Umrechnung der Erträge und Aufwendungen aus Fremdwährungen zum 30. Juni 2020 und zum 30. Juni 2019 wurden die folgenden durchschnittlichen Wechselkurse verwendet:

	30. Juni 2020	30. Juni 2020	30. Juni 2020
	USD	EUR	GBP
Euro	0,9045	1,0000	1,1402
Britisches Pfund	0,7938	0,8771	1,0000
US-Dollar	1,0000	1,1056	1,2597

	30. Juni 2019	30. Juni 2019	30. Juni 2019
	USD	EUR	GBP
Euro	0,8766	1,0000	1,1344
Britisches Pfund	0,7727	0,8815	1,0000
US-Dollar	1,0000	1,14077	1,2942

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft)

### I. Allgemeine Daten

„Wertpapier- oder Warenleihgeschäfte“ sind in Artikel 3(7) der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung (die „Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften“) definiert. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 hat die Gesellschaft keine Wertpapier- oder Warenleihgeschäfte für einen ihrer Fonds getätigt.

„Wertpapierfinanzierungsgeschäft“ oder „WFG“ ist in Artikel 3(11) der Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften definiert. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 waren die einzigen WFG, in die die Gesellschaft anlegte, umgekehrte Pensionsgeschäfte, die sie nur in Bezug auf die Fonds mit synthetischer Nachbildung einging.

„Total Return Swap“ ist in Artikel 3(18) der Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften definiert. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 ging die Gesellschaft nur in Bezug auf die Fonds mit synthetischer Nachbildung Total Return Swaps (in diesem Jahresabschluss als „OTC-Swaps“ definiert) ein.

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 erzielten die Fonds mit synthetischer Nachbildung Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften. Diese Erträge wurden vollständig an die jeweiligen Fonds mit synthetischer Nachbildung überwiesen und werden in der Gesamtergebnisrechnung beginnend auf Seite 79 ausgewiesen.

### II. Konzentrationsdaten

In den nachstehenden Tabellen sind die zehn größten Emittenten nach dem Wert der von den einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung per 30. Juni 2020 im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) Sachsicherheiten aufgeführt:

Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten		Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF</b>	€		<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	€
Kingdom of Belgium Government Bond	5.602.163		Kingdom of Belgium Government Bond	12.781.349
United Kingdom Gilt	5.597.224		French Republic Government Bond OAT	12.774.855
French Republic Government Bond OAT	5.565.901		United Kingdom Gilt	12.769.683
GFL Environmental Inc	1.401.024		GFL Environmental Inc	3.196.400
Sanofi	1.400.978		Otis Worldwide Corp	3.196.248
Adobe Inc	1.400.818		Exxon Mobil Corp	3.191.503
L'Oreal SA	1.068.011		Porsche Automobil Holding SE	2.879.989
Harworth Group Plc	930.145		Telecom Italia SpA/Milano	2.802.653
Henry Boot Plc	913.126		TechnipFMC Plc	2.384.809
Renewi Plc	890.398		Chiyoda Corp	1.683.353

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF</b>	<b>\$</b>	<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF</b>	<b>£</b>
Porsche Automobil Holding SE	20.223.021	Evoform Biosciences Inc	576.669
Prudential Plc	20.223.015	GFL Environmental Inc	576.669
Symrise AG	20.222.997	Axcella Health Inc	576.667
Getlink SE	20.222.916	Renewi Plc	576.666
Ingenico Group SA	20.222.101	Schaeffler AG	576.666
Dialog Semiconductor Plc	17.312.278	Harworth Group Plc	576.664
Ubisoft Entertainment SA	17.171.828	Henry Boot Plc	576.659
Eiffage SA	16.334.533	Porsche Automobil Holding SE	576.640
Next Plc	15.581.394	PBF Energy Inc	576.631
HSBC Holdings Plc	15.432.670	Ingenico Group SA	576.611
<b>L&amp;G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF</b>	<b>£</b>	<b>L&amp;G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF</b>	<b>\$</b>
French Republic Government Bond OAT	4.703.660	Hyve Group Plc	2.258.036
Kingdom of Belgium Government Bond	4.701.080	Electricite de France SA	2.258.031
United Kingdom Gilt	4.697.808	St James's Place Plc	2.258.031
GFL Environmental Inc	1.175.907	Getlink SE	2.258.030
L'Oreal SA	1.175.900	Rakus Co Ltd	2.258.024
T-Mobile US Inc	1.175.885	Porsche Automobil Holding SE	2.258.022
Harworth Group Plc	845.509	Infineon Technologies AG	2.257.997
Henry Boot Plc	830.039	Taoka Chemical Co Ltd	2.257.958
Renewi Plc	710.211	SEB SA	2.257.924
ICL Group Ltd	554.078	Iliad SA	2.257.912
<b>L&amp;G Gold Mining UCITS ETF</b>	<b>\$</b>	<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	<b>\$</b>
Toshiba Corp	12.104.933	Kingdom of Belgium Government Bond	2.511.097
Getlink SE	12.104.879	United Kingdom Gilt	2.508.393
Electricite de France SA	12.104.877	French Republic Government Bond OAT	2.502.878
Porsche Automobil Holding SE	12.104.872	Sampo Oyj	627.916
Infineon Technologies AG	12.104.859	Carrier Global Corp	627.915
British American Tobacco Plc	12.104.516	Pernod Ricard SA	627.866
Vonovia SE	12.104.383	Endesa SA	627.798
Barclays Plc	12.092.790	Otis Worldwide Corp	627.734
Prudential Plc	11.953.730	MarketAxess Holdings Inc	627.653
DS Smith Plc	11.403.611	L'Oreal SA	626.148



## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten	Sicherheitenemittent	Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten
<b>L&amp;G All Commodities UCITS ETF</b>	<b>\$</b>	<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF</b>	<b>\$</b>
Schroders Plc	2.295.895	Volution Group Plc	361.227
Bureau Veritas SA	2.295.891	HSBC Holdings Plc	361.225
HSBC Holdings Plc	2.295.888	Getlink SE	361.223
Hapag-Lloyd AG	2.295.880	United Utilities Group Plc	361.219
Ubisoft Entertainment SA	2.295.867	DMG Mori AG	361.208
Ingenico Group SA	2.295.761	TLG Immobilien AG	361.208
Getlink SE	2.295.756	Grifols SA	361.206
GrandVision NV	2.295.686	Hapag-Lloyd AG	361.198
Dialog Semiconductor Plc	2.275.486	GrandVision NV	361.156
Grifols SA	2.073.226	Ingenico Group SA	361.106

Die nachstehenden Tabellen liefern eine Währungsanalyse der von den einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung per 30. Juni 2020 im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) Sachsicherheiten:

Währung	Währung
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF</b>	<b>L&amp;G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF</b>
<b>€</b>	<b>£</b>
Kanadischer Dollar	Kanadischer Dollar
1.401.023	576.668
Euro	Euro
15.344.246	3.913.330
Japanischer Yen	Japanischer Yen
744.762	2.874.049
Britisches Pfund	Britisches Pfund
9.996.817	2.828.227
US-Dollar	Schweizer Franken
1.636.358	146.495
	US-Dollar
	2.320.508
	<b>12.659.277</b>
<b>L&amp;G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF</b>	<b>L&amp;G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF</b>
<b>€</b>	<b>£</b>
Kanadischer Dollar	Kanadischer Dollar
3.196.400	1.175.906
Euro	Euro
32.904.753	11.319.618
Japanischer Yen	Japanischer Yen
3.430.787	154.731
Britisches Pfund	Japanischer Yen
17.237.215	554.079
Schweizer Franken	Israelischer Neuer Schekel
161.158	554.079
US-Dollar	Britisches Pfund
9.545.417	9.499.480
	Schweizer Franken
	101.877
	US-Dollar
	1.655.023
<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities UCITS ETF</b>	<b>L&amp;G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF</b>
<b>\$</b>	<b>\$</b>
Australischer Dollar	Australischer Dollar
4.514.875	132.219
Kanadischer Dollar	Euro
75.845	26.964.165
Euro	Japanischer Yen
215.114.523	11.277.737
Japanischer Yen	Britisches Pfund
101.115.340	10.365.238
Norwegische Krone	
12.454.347	
Britisches Pfund	
82.166.709	
Schweizer Franken	
714.681	
US-Dollar	
17.673.753	
<b>433.830.073</b>	<b>48.739.359</b>

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

Währung		Währung	
<b>L&amp;G Gold Mining UCITS ETF</b>	<b>\$</b>	<b>L&amp;G All Commodities UCITS ETF</b>	<b>\$</b>
Australischer Dollar	3.493.833	Euro	29.825.904
Euro	134.814.219	Japanischer Yen	11.479.508
Japanischer Yen	60.524.627	Britisches Pfund	7.226.526
Britisches Pfund	60.508.659	US-Dollar	1.057.851
	<b>259.341.338</b>		<b>49.589.789</b>
<b>L&amp;G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF</b>	<b>\$</b>	<b>L&amp;G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF</b>	<b>\$</b>
Euro	8.149.421	Euro	4.690.050
Britisches Pfund	2.828.515	Japanischer Yen	1.806.130
US-Dollar	1.906.343	Britisches Pfund	1.128.791
	<b>12.884.279</b>	US-Dollar	225.370
			<b>7.850.341</b>

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 (ungeprüft) (Fortsetzung)

### II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

In der nachstehenden Tabelle ist für die einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung der Zeitwert der umgekehrten Pensionsgeschäfte und OTC-Swaps je Kontrahent per 30. Juni 2020 aufgeführt:

Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Kontrahenten	L&G DAX® Daily 2x Long UCITS ETF	L&G DAX® Daily 2x Short UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF	L&G FTSE 100® Leveraged (Daily 2x) UCITS ETF	L&G FTSE 100® Super Short Strategy (Daily 2x) UCITS ETF	L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	L&G Gold Mining UCITS ETF	L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
	€	€	\$	£	£	\$	\$	\$
Merrill Lynch International	–	–	–	–	–	45.160.750	242.098.799	–
Citigroup Global Markets Limited	27.985.328	63.846.403	–	11.616.000	23.686.751	–	–	12.558.700
Barclays Bank Plc	–	–	404.461.433	–	–	–	–	–
	<b>27.985.328</b>	<b>63.846.403</b>	<b>404.461.433</b>	<b>11.616.000</b>	<b>23.686.751</b>	<b>45.160.750</b>	<b>242.098.799</b>	<b>12.558.700</b>

Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Kontrahenten	L&G All Commodities UCITS ETF	L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF
	Zeitwert	Zeitwert
	\$	\$
Merrill Lynch International	–	–
Citigroup Global Markets Limited	–	–
Barclays Bank Plc	45.918.070	7.224.553
	<b>45.918.070</b>	<b>7.224.553</b>

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Kontrahenten	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 \$
Merrill Lynch International	–	–	–	–	–	48.739.359	259.341.338	–
Citigroup Global Markets Limited	29.123.206	66.475.730	–	12.659.277	24.460.714	–	–	12.884.279
Barclays Bank Plc	–	–	433.830.073	–	–	–	–	–
	<b>29.123.206</b>	<b>66.475.730</b>	<b>433.830.073</b>	<b>12.659.277</b>	<b>24.460.714</b>	<b>48.739.359</b>	<b>259.341.338</b>	<b>12.884.279</b>

Umgekehrte Pensionsgeschäfte – Kontrahenten	L&G All Commodities UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten \$	L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten \$
Merrill Lynch International	–	–
Citigroup Global Markets Limited	–	–
Barclays Bank Plc	49.589.789	7.850.341
	<b>49.589.789</b>	<b>7.850.341</b>

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### II. Konzentrationsdaten (Fortsetzung)

OTC-Swaps – Kontrahenten	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 \$
Merrill Lynch International	–	–	–	–	–	284.054	13.355.572	–
Citigroup Global Markets Limited	176.861	(951.684)	–	(317.987)	526.945	–	–	(240.235)
Barclays Bank Plc	–	–	1.951.562	–	–	–	–	–
	<b>176.861</b>	<b>(951.684)</b>	<b>1.951.562</b>	<b>(317.987)</b>	<b>526.945</b>	<b>284.054</b>	<b>13.355.572</b>	<b>(240.235)</b>

OTC-Swaps – Kontrahenten	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 \$
Merrill Lynch International	–	–
Citigroup Global Markets Limited	–	–
Barclays Bank Plc	113.694	33.305
	<b>113.694</b>	<b>33.305</b>

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### III. Transaktionsdaten

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der entgegengenommenen Sicherheiten für die umgekehrten Pensionsgeschäfte per 30. Juni 2020:

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	-	-	-	-	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	16.765.288	38.325.888	-	-	14.102.548	-	-	7.522.367
Offene Fälligkeit	12.357.918	28.149.842	433.830.073	12.659.277	10.358.166	48.739.359	259.341.338	5.361.912
	<b>29.123.206</b>	<b>66.475.730</b>	<b>433.830.073</b>	<b>12.659.277</b>	<b>24.460.714</b>	<b>48.739.359</b>	<b>259.341.338</b>	<b>12.884.279</b>

Fälligkeitsprofil	L&G All Commodities UCITS ETF Marktwert der entgegengenommenen Sicherheiten \$	L&G Longer Dated All Commodities ex-Agriculture and Livestock 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	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-
Offene Fälligkeit	49.589.789	7.850.341
	<b>49.589.789</b>	<b>7.850.341</b>

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### III. Transaktionsdaten (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2020:

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	27.985.328	63.846.403	404.461.433	11.616.000	23.686.751	45.160.750	242.098.799	12.558.700
Ein bis drei Monate	-	-	-	-	-	-	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-	-	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-	-	-	-	-	-	-
Offene Fälligkeit	-	-	-	-	-	-	-	-
	<b>27.985.328</b>	<b>63.846.403</b>	<b>404.461.433</b>	<b>11.616.000</b>	<b>23.686.751</b>	<b>45.160.750</b>	<b>242.098.799</b>	<b>12.558.700</b>

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	45.918.070	7.224.553
Ein bis drei Monate	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-
Offene Fälligkeit	-	-
	<b>45.918.070</b>	<b>7.224.553</b>

## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### III. Transaktionsdaten (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle zeigt das Fälligkeitsprofil der OTC-Swap-Transaktionen zum 30. Juni 2020:

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	176.861	(951.684)	1.951.562	(317.987)	526.945	284.054	13.355.572	-
Ein bis drei Monate	-	-	-	-	-	-	-	(240.235)
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-	-	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-	-	-	-	-	-	-
Offene Fälligkeit	-	-	-	-	-	-	-	-
	<b>176.861</b>	<b>(951.684)</b>	<b>1.951.562</b>	<b>(317.987)</b>	<b>526.945</b>	<b>284.054</b>	<b>13.355.572</b>	<b>(240.235)</b>

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	113.694	33.305
Ein bis drei Monate	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-
Offene Fälligkeit	-	-
	<b>113.694</b>	<b>33.305</b>

Einzelheiten zur Abrechnung, zum Clearing und zur sicheren Verwahrung der von den einzelnen Fonds mit synthetischer Nachbildung entgegengenommenen (d. h. gehaltenen) und gestellten Sicherheiten entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „3.C.(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“ in Anmerkung 12 in diesem Jahresabschluss.

Einzelheiten zur Wiederverwendung von Sicherheiten entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „3.C.(i) OTC-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte“ in Anmerkung 12 in diesem Jahresabschluss.



## Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft) (Fortsetzung)

### III. Transaktionsdaten (Fortsetzung)

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 (ungeprüft)

Die Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe spiegelt die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers wider, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe bzw. Verkäufe innerhalb des Geschäftsjahres übersteigen. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe angegeben werden.

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
2.100	Kweichow Moutai Co Ltd 'A'	388.682
25.600	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	288.925
46.700	China Merchants Bank Co Ltd 'A'	229.076
11.300	Contemporary Amperex Technology Co Ltd 'A'	162.879
71.000	East Money Information Co Ltd 'A'	146.496
20.800	Wanhua Chemical Group Co Ltd 'A'	144.875
6.100	Wuliangye Yibin Co Ltd 'A'	128.317
8.800	WuXi AppTec Co Ltd 'A'	110.475
13.500	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai 'A'	107.102
44.100	Industrial Bank Co Ltd 'A'	104.354
11.900	Midea Group Co Ltd 'A'	93.618
3.300	Gigadevice Semiconductor Beijing Inc 'A'	84.396
5.400	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd 'A'	83.601
25.500	CITIC Securities Co Ltd 'A'	82.226
53.600	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd 'A'	82.180
6.301	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd 'A'	71.283
17.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A'	70.555
94.500	China State Construction Engineering Corp Ltd 'A'	69.646
15.400	Yonyou Network Technology Co Ltd 'A'	68.270
81.400	China Railway Group Ltd 'A'	67.054

**L&G E Fund MSCI China A UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
35.400	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	396.985
1.700	Kweichow Moutai Co Ltd 'A'	278.400
46.600	China Merchants Bank Co Ltd 'A'	232.802
18.400	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai 'A'	153.508
56.600	Industrial Bank Co Ltd 'A'	136.332
142.300	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A'	119.003
16.701	Luxshare Precision Industry Co Ltd 'A'	112.029
5.700	Wuliangye Yibin Co Ltd 'A'	109.989
32.200	CITIC Securities Co Ltd 'A'	103.427
47.200	Haitong Securities Co Ltd 'A'	100.052
9.700	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd 'A'	96.084
58.100	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd 'A'	92.191
22.200	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A'	90.790
21.000	China Vanke Co Ltd 'A'	86.978
11.900	Inspur Electronic Information Industry Co Ltd 'A'	78.549
10.100	Midea Group Co Ltd 'A'	77.798
6.700	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd 'A'	75.671
6.100	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd 'A'	75.110
92.500	China State Construction Engineering Corp Ltd 'A'	73.456
15.100	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd 'A'	71.977

L&G DAX<sup>®</sup> Daily 2x Long UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten €
31.730.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	31.730.328
30.085.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,51) %	22.07.2020	30.085.328
29.655.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	29.655.328
28.119.515	Citigroup Global Markets Limited	(0,41) %	22.08.2019	28.119.515
27.985.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,51) %	22.07.2020	27.985.328
27.110.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	27.110.328
26.276.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	26.276.130
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
25.345.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	25.345.328
24.921.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	24.921.130
24.844.515	Citigroup Global Markets Limited	(0,41) %	22.08.2019	24.844.515
24.775.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	24.775.328
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
22.870.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	22.870.328
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
22.210.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	22.210.328
21.575.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	21.575.328
21.284.515	Citigroup Global Markets Limited	(0,41) %	22.08.2019	21.284.515
20.345.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	20.345.328
20.308.439	Citigroup Global Markets Limited	(0,41) %	24.09.2019	20.308.439
19.565.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	19.565.130
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
18.366.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	18.366.130
18.170.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	18.170.130
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
16.790.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	16.790.130
16.566.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	16.566.130
16.052.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,44) %	22.11.2019	16.052.130
15.855.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	15.855.130
15.619.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,46) %	24.12.2019	15.619.130
14.815.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	14.815.130
14.611.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	14.611.130
13.680.130	Merrill Lynch International	(0,48) %	24.03.2020	13.680.130
12.650.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	12.650.000
11.800.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	11.800.130

L&G DAX<sup>®</sup> Daily 2x Long UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse €
31.730.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	31.730.328
30.435.515	Citigroup Global Markets Limited	(0,40) %	23.07.2019	30.435.515
30.085.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,51) %	22.07.2020	30.085.328
29.655.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	29.655.328
28.119.515	Citigroup Global Markets Limited	(0,41) %	22.08.2019	28.119.515
27.110.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	27.110.328
26.276.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	26.276.130
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
25.345.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	25.345.328
24.921.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	24.921.130
24.844.515	Citigroup Global Markets Limited	(0,41) %	22.08.2019	24.844.515
24.775.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	24.775.328
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
22.870.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	22.870.328
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
22.210.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	22.210.328
21.575.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	21.575.328
21.284.515	Citigroup Global Markets Limited	(0,41) %	22.08.2019	21.284.515
20.345.328	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	20.345.328
20.308.439	Citigroup Global Markets Limited	(0,41) %	24.09.2019	20.308.439
19.565.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	19.565.130
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
18.366.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	18.366.130
18.170.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	18.170.130
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
16.790.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	16.790.130
16.566.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	16.566.130
16.052.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,44) %	22.11.2019	16.052.130
15.855.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	15.855.130
15.619.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,46) %	24.12.2019	15.619.130
14.815.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	14.815.130
14.611.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	14.611.130
13.680.130	Merrill Lynch International	(0,48) %	24.03.2020	13.680.130
12.650.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	12.650.000
11.800.130	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	11.800.130

L&G DAX<sup>®</sup> Daily 2x Short UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten €
85.811.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	85.811.000
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
69.791.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	69.791.000
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
65.566.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	65.566.000
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
63.155.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	63.155.000
63.129.481	Citigroup Global Markets Limited	(0,40) %	23.07.2019	63.129.481
62.876.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	62.876.000
62.273.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	62.273.403
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
61.367.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	61.367.000
60.409.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.01.2020	60.409.000
58.787.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	58.787.000
58.435.967	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	23.10.2019	58.435.967
58.100.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	58.100.000
57.673.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	57.673.403
55.275.967	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	23.10.2019	55.275.967
55.032.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	55.032.000
54.685.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	54.685.000
54.646.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,51) %	22.07.2020	54.646.403
54.611.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	54.611.000
52.678.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	52.678.403
52.362.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	52.362.000
52.178.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	52.178.403
50.886.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	50.886.000
47.923.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	47.923.403
46.781.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	46.781.000
45.200.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	45.200.000
44.503.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	44.503.403
42.503.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	42.503.403
42.500.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	42.500.000
38.885.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	38.885.000
38.884.541	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	04.05.2020	38.884.541
38.125.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	38.125.000
35.730.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	35.730.000
31.200.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	31.200.000

L&G DAX<sup>®</sup> Daily 2x Short UCITS ETF

## Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse €
85.811.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	85.811.000
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
69.791.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	69.791.000
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
65.566.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	65.566.000
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
63.314.000	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
63.155.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	63.155.000
63.129.481	Citigroup Global Markets Limited	(0,40) %	23.07.2019	63.129.481
62.876.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	62.876.000
62.273.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	62.273.403
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
61.367.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	61.367.000
60.409.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.01.2020	60.409.000
58.787.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	58.787.000
58.435.967	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	23.10.2019	58.435.967
58.100.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	58.100.000
57.673.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	57.673.403
55.275.967	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	23.10.2019	55.275.967
55.032.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	55.032.000
54.685.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	54.685.000
54.611.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	54.611.000
52.678.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	52.678.403
52.362.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,47) %	24.02.2020	52.362.000
52.178.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	52.178.403
50.886.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	50.886.000
47.923.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	47.923.403
46.781.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,45) %	22.04.2020	46.781.000
45.200.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	45.200.000
44.503.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	44.503.403
42.503.403	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.06.2020	42.503.403
42.500.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	42.500.000
38.885.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	38.885.000
38.884.541	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	04.05.2020	38.884.541
38.125.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	38.125.000
35.730.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,43) %	22.05.2020	35.730.000
31.200.000	Citigroup Global Markets Limited	(0,48) %	24.03.2020	31.200.000

## L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
647.479.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	647.479.449
618.180.449	Barclays Bank Plc	1,69 %	24.02.2020	618.180.449
592.329.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	592.329.449
591.350.449	Barclays Bank Plc	1,69 %	24.02.2020	591.350.449
562.716.449	Barclays Bank Plc	1,81 %	23.01.2020	562.716.449
535.294.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	535.294.449
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
498.784.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	498.784.449
453.709.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	453.709.449
390.053.433	Barclays Bank Plc	0,31 %	22.07.2020	390.053.433
376.249.449	Barclays Bank Plc	1,63 %	24.03.2020	376.249.449
375.355.433	Barclays Bank Plc	0,21 %	24.06.2020	375.355.433
369.999.449	Barclays Bank Plc	0,70 %	22.05.2020	369.999.449
360.734.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	360.734.449
346.809.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	346.809.449
281.925.449	Barclays Bank Plc	0,96 %	22.04.2020	281.925.449
265.105.449	Barclays Bank Plc	0,96 %	22.04.2020	265.105.449



## L&G Longer Dated All Commodities UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
647.479.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	647.479.449
618.180.449	Barclays Bank Plc	1,69 %	24.02.2020	618.180.449
592.329.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	592.329.449
591.350.449	Barclays Bank Plc	1,69 %	24.02.2020	591.350.449
562.716.449	Barclays Bank Plc	1,81 %	23.01.2020	562.716.449
535.294.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	535.294.449
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
498.784.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	498.784.449
453.709.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	453.709.449
376.249.449	Barclays Bank Plc	1,63 %	24.03.2020	376.249.449
375.355.433	Barclays Bank Plc	0,21 %	24.06.2020	375.355.433
369.999.449	Barclays Bank Plc	0,70 %	22.05.2020	369.999.449
360.734.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	360.734.449
346.809.449	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	346.809.449
281.925.449	Barclays Bank Plc	0,96 %	22.04.2020	281.925.449
265.105.449	Barclays Bank Plc	0,96 %	22.04.2020	265.105.449

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

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten £
12.216.000	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2020	12.216.000
11.954.000	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	11.954.000
11.804.000	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	11.804.000
11.743.000	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	11.743.000
11.616.000	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2020	11.616.000
10.689.000	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	10.689.000
10.243.000	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	10.243.000
9.959.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	22.01.2020	9.959.000
9.959.000	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	9.959.000
9.579.000	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	9.579.000
9.104.000	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	9.104.000
9.078.000	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	9.078.000
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
7.856.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	7.856.000
7.556.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	7.556.000
6.867.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	22.11.2019	6.867.000
6.839.000	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	6.839.000
6.822.000	Citigroup Global Markets Limited	0,72 %	24.12.2019	6.822.000
6.686.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	6.686.000
6.306.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	6.306.000
6.128.356	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	23.10.2019	6.128.356
5.861.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	5.861.000
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
5.130.000	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	5.130.000
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
4.446.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	4.446.000
3.370.000	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	3.370.000

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

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
12.216.000	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2020	12.216.000
11.954.000	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	11.954.000
11.804.000	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	11.804.000
11.743.000	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	11.743.000
10.689.000	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	10.689.000
10.243.000	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	10.243.000
9.959.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	22.01.2020	9.959.000
9.959.000	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	9.959.000
9.579.000	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	9.579.000
9.104.000	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	9.104.000
9.078.000	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	9.078.000
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
7.856.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	7.856.000
7.556.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	7.556.000
6.867.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	22.11.2019	6.867.000
6.839.000	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	6.839.000
6.822.000	Citigroup Global Markets Limited	0,72 %	24.12.2019	6.822.000
6.686.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	6.686.000
6.306.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	6.306.000
6.128.356	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	23.10.2019	6.128.356
5.861.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	5.861.000
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
5.130.000	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	5.130.000
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
4.446.000	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	4.446.000
3.370.000	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	3.370.000

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

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten £
26.390.751	Citigroup Global Markets Limited	0,00 %	24.06.2020	26.390.751
24.340.751	Citigroup Global Markets Limited	0,00 %	24.06.2020	24.340.751
24.134.751	Citigroup Global Markets Limited	0,00 %	22.07.2020	24.134.751
22.805.751	Citigroup Global Markets Limited	0,00 %	24.06.2020	22.805.751
22.354.751	Citigroup Global Markets Limited	0,00 %	22.07.2020	22.354.751
22.215.751	Citigroup Global Markets Limited	0,00 %	22.04.2020	22.215.751
21.375.751	Citigroup Global Markets Limited	0,00 %	24.06.2020	21.375.751
20.861.751	Citigroup Global Markets Limited	0,00 %	22.05.2020	20.861.751
20.155.751	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	20.155.751
19.990.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	19.990.751
17.970.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	17.970.751
17.631.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	17.631.751
14.926.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	14.926.751
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
13.661.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	13.661.751
13.466.751	Citigroup Global Markets Limited	0,72 %	24.12.2019	13.466.751
13.382.751	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	13.382.751
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
12.855.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	12.855.751
12.595.737	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.09.2019	12.595.737
12.527.751	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	12.527.751
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
11.001.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	11.001.751
10.965.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	10.965.751
10.561.751	Citigroup Global Markets Limited	0,72 %	24.12.2019	10.561.751
10.522.751	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	10.522.751
9.992.751	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	9.992.751
9.895.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	9.895.751
8.815.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	8.815.751
8.106.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	8.106.751
7.597.751	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	7.597.751
7.020.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	7.020.751

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

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse £
26.390.751	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	26.390.751
24.340.751	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	24.340.751
24.134.751	Citigroup Global Markets Limited	0,10 %	22.07.2020	24.134.751
22.805.751	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	22.805.751
22.215.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	22.215.751
21.375.751	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	21.375.751
20.861.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	20.861.751
20.155.751	Citigroup Global Markets Limited	0,12 %	24.06.2020	20.155.751
19.990.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	19.990.751
17.970.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	17.970.751
17.631.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	17.631.751
14.926.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	14.926.751
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
13.661.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	13.661.751
13.466.751	Citigroup Global Markets Limited	0,72 %	24.12.2019	13.466.751
13.382.751	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	13.382.751
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
12.855.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	12.855.751
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
12.527.751	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	12.527.751
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
11.001.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	11.001.751
10.965.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	10.965.751
10.561.751	Citigroup Global Markets Limited	0,72 %	24.12.2019	10.561.751
10.522.751	Citigroup Global Markets Limited	0,71 %	24.03.2020	10.522.751
9.992.751	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	9.992.751
9.895.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	9.895.751
8.815.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	8.815.751
8.106.751	Citigroup Global Markets Limited	0,25 %	22.05.2020	8.106.751
7.597.751	Citigroup Global Markets Limited	0,64 %	24.02.2020	7.597.751
7.020.751	Citigroup Global Markets Limited	0,24 %	22.04.2020	7.020.751

## L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

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
51.254.750	Merrill Lynch International	1,78 %	23.01.2020	51.254.750
51.254.750	Merrill Lynch International	1,66 %	24.02.2020	51.254.750
51.254.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	51.254.750
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	Barclays Bank Plc	2,23 %	22.08.2019	49.223.021
48.439.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	48.439.750
47.425.750	Merrill Lynch International	0,18 %	22.07.2020	47.425.750
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	Barclays Bank Plc	2,23 %	22.08.2019	46.798.021
46.099.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	46.099.750
45.825.750	Merrill Lynch International	0,17 %	24.06.2020	45.825.750
45.160.750	Merrill Lynch International	0,18 %	22.07.2020	45.160.750
44.628.021	Barclays Bank Plc	2,23 %	22.08.2019	44.628.021
42.539.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	42.539.750
40.459.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	40.459.750
38.167.750	Merrill Lynch International	0,62 %	22.05.2020	38.167.750
36.444.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	36.444.750
33.864.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	33.864.750
29.684.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	29.684.750
26.609.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	26.609.750
23.174.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	23.174.750
19.270.000	Merrill Lynch International	0,93 %	22.04.2020	19.270.000
12.407.750	Merrill Lynch International	0,93 %	22.04.2020	12.407.750

## L&G Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse 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
51.254.750	Merrill Lynch International	1,78 %	23.01.2020	51.254.750
51.254.750	Merrill Lynch International	1,66 %	24.02.2020	51.254.750
51.254.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	51.254.750
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	Barclays Bank Plc	2,23 %	22.08.2019	49.223.021
48.439.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	48.439.750
47.425.750	Merrill Lynch International	0,18 %	22.07.2020	47.425.750
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	Barclays Bank Plc	2,23 %	22.08.2019	46.798.021
46.099.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	46.099.750
45.825.750	Merrill Lynch International	0,17 %	24.06.2020	45.825.750
45.557.021	Barclays Bank Plc	2,37 %	23.07.2019	45.557.021
44.628.021	Barclays Bank Plc	2,23 %	22.08.2019	44.628.021
42.539.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	42.539.750
40.459.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	40.459.750
38.167.750	Merrill Lynch International	0,62 %	22.05.2020	38.167.750
36.444.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	36.444.750
33.864.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	33.864.750
29.684.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	29.684.750
26.609.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	26.609.750
23.174.750	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	23.174.750
19.270.000	Merrill Lynch International	0,93 %	22.04.2020	19.270.000
12.407.750	Merrill Lynch International	0,93 %	22.04.2020	12.407.750

## L&G Gold Mining UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
263.158.799	Merrill Lynch International	0,17 %	24.06.2020	263.158.799
246.608.799	Merrill Lynch International	0,17 %	24.06.2020	246.608.799
238.561.799	Merrill Lynch International	1,71 %	24.12.2019	238.561.799
238.405.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	238.405.799
235.033.135	Merrill Lynch International	1,82 %	22.11.2019	235.033.135
233.258.799	Merrill Lynch International	0,62 %	22.05.2020	233.258.799
231.643.799	Merrill Lynch International	0,17 %	24.06.2020	231.643.799
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
223.148.799	Citigroup Global Markets Limited	0,17 %	24.06.2020	223.148.799
223.148.799	Merrill Lynch International	0,18 %	22.07.2020	223.148.799
222.928.799	Merrill Lynch International	0,62 %	22.05.2020	222.928.799
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
217.322.799	Merrill Lynch International	1,66 %	24.02.2020	217.322.799
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
208.132.799	Merrill Lynch International	1,66 %	24.02.2020	208.132.799
206.150.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	206.150.799
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
184.365.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	184.365.799
173.730.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	173.730.799
160.505.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	160.505.799
132.670.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	132.670.799
106.005.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	106.005.799
96.923.799	Merrill Lynch International	0,93 %	22.04.2020	96.923.799
76.355.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	76.355.799



## L&G Gold Mining UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
263.158.799	Merrill Lynch International	0,17 %	24.06.2020	263.158.799
246.608.799	Merrill Lynch International	0,17 %	24.06.2020	246.608.799
238.561.799	Merrill Lynch International	1,71 %	24.12.2019	238.561.799
238.405.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	238.405.799
235.033.135	Merrill Lynch International	1,82 %	22.11.2019	235.033.135
233.258.799	Merrill Lynch International	0,62 %	22.05.2020	233.258.799
231.643.799	Merrill Lynch International	0,17 %	24.06.2020	231.643.799
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
223.148.799	Citigroup Global Markets Limited	0,17 %	24.06.2020	223.148.799
222.928.799	Merrill Lynch International	0,62 %	22.05.2020	222.928.799
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
217.322.799	Merrill Lynch International	1,66 %	24.02.2020	217.322.799
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
208.132.799	Merrill Lynch International	1,66 %	24.02.2020	208.132.799
206.150.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	206.150.799
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
184.365.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	184.365.799
173.730.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	173.730.799
160.505.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	160.505.799
132.670.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	132.670.799
106.005.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	106.005.799
96.923.799	Merrill Lynch International	0,93 %	22.04.2020	96.923.799
76.355.799	Merrill Lynch International	1,63 %	24.03.2020	76.355.799

## L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

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
16.827.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	16.827.700
15.904.700	Citigroup Global Markets Limited	1,78 %	23.01.2020	15.904.700
15.904.700	Citigroup Global Markets Limited	1,66 %	24.02.2020	15.904.700
15.892.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	15.892.700
15.009.700	Citigroup Global Markets Limited	1,71 %	24.12.2019	15.009.700
14.277.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	14.277.700
14.274.700	Citigroup Global Markets Limited	1,71 %	24.12.2019	14.274.700
13.547.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	13.547.700
13.068.700	Citigroup Global Markets Limited	0,18 %	22.07.2020	13.068.700
12.558.700	Citigroup Global Markets Limited	0,18 %	22.07.2020	12.558.700
9.298.700	Citigroup Global Markets Limited	0,62 %	22.05.2020	9.298.700
8.677.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	8.677.700
8.663.700	Citigroup Global Markets Limited	0,62 %	22.05.2020	8.663.700
8.587.700	Citigroup Global Markets Limited	0,17 %	24.06.2020	8.587.700
8.137.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	8.137.700
8.043.700	Citigroup Global Markets Limited	0,62 %	22.05.2020	8.043.700
7.272.700	Citigroup Global Markets Limited	0,93 %	22.04.2020	7.272.700
7.022.700	Citigroup Global Markets Limited	0,93 %	22.04.2020	7.022.700
6.542.700	Citigroup Global Markets Limited	0,93 %	22.04.2020	6.542.700
6.492.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	6.492.700
6.292.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	6.292.700
6.077.700	Citigroup Global Markets Limited	0,93 %	22.04.2020	6.077.700

## L&G US Energy Infrastructure MLP UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

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
16.827.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	16.827.700
15.904.700	Citigroup Global Markets Limited	1,78 %	23.01.2020	15.904.700
15.904.700	Citigroup Global Markets Limited	1,66 %	24.02.2020	15.904.700
15.892.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	15.892.700
15.009.700	Citigroup Global Markets Limited	1,71 %	24.12.2019	15.009.700
14.277.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	14.277.700
14.274.700	Citigroup Global Markets Limited	1,71 %	24.12.2019	14.274.700
13.547.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	13.547.700
13.068.700	Citigroup Global Markets Limited	0,18 %	22.07.2020	13.068.700
9.298.700	Citigroup Global Markets Limited	0,62 %	22.05.2020	9.298.700
8.677.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	8.677.700
8.663.700	Citigroup Global Markets Limited	0,62 %	22.05.2020	8.663.700
8.587.700	Citigroup Global Markets Limited	0,17 %	24.06.2020	8.587.700
8.137.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	8.137.700
8.043.700	Citigroup Global Markets Limited	0,62 %	22.05.2020	8.043.700
7.272.700	Citigroup Global Markets Limited	0,93 %	22.04.2020	7.272.700
7.022.700	Citigroup Global Markets Limited	0,93 %	22.04.2020	7.022.700
6.542.700	Citigroup Global Markets Limited	0,93 %	22.04.2020	6.542.700
6.492.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	6.492.700
6.292.700	Citigroup Global Markets Limited	1,63 %	24.03.2020	6.292.700
6.077.700	Citigroup Global Markets Limited	0,93 %	22.04.2020	6.077.700

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

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
649.893	Vocera Communications Inc	15.801.294
44.473	ServiceNow Inc	13.495.575
196.220	iRobot Corp	10.817.656
748.364	Blue Prism Group plc	10.143.812
483.633	Hollysys Automation Technologies Ltd	7.458.037
27.427	Illumina Inc	7.189.571
68.589	Manhattan Associates Inc	5.414.417
80.088	Krones AG	4.998.580
988.600	Iflytek Co Ltd	4.754.180
2.306.732	Adlink Technology Inc	4.455.475
229.802	Stratasys Ltd	4.428.052
192.446	Raven Industries Inc	4.330.688
190.300	Amano Corp	4.243.149
171.361	Cargotec Oyj - Class B	4.224.688
406.472	Elektro AB	4.007.397
153.870	Duerr AG	3.890.119
249.000	Yokogawa Electric Corp	3.690.854
52.098	Omniceil Inc	3.668.308
67.031	Ambarella Inc	3.595.447
97.959	FLIR Systems Inc	3.468.495
159.768	Jenoptik AG	3.448.184
437.066	3D Systems Corp	3.370.567
99.082	Brooks Automation Inc	3.324.093
28.245	Varian Medical Systems Inc	3.285.397
22.058	Kardex Holding AG	3.216.789
337.418	Hiwin Technologies Corp	3.192.362
34.262	Xilinx Inc	3.129.490
94.693	Yaskawa Electric Corp	3.061.686
47.115	AeroVironment Inc	2.958.903
68.649	BioTelemetry Inc	2.830.037
142.231	Nuance Communications Inc	2.812.726
43.073	PTC Inc	2.785.867
89.800	Nabtesco Corp	2.753.799
151.855	Materialise NV ADR	2.733.120
198.761	ATS Automation Tooling Systems Inc	2.730.708
34.962	John Bean Technologies Corp	2.708.133
29.042	Siemens AG	2.693.416
55.175	KION Group AG	2.679.169

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

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
62.929	NVIDIA Corp	14.005.947
846.327	Oceaneering International Inc	12.363.482
191.030	iRobot Corp	12.313.972
238.289	Isra Vision AG	11.707.205
226.800	Harmonic Drive Systems Inc	10.688.625
258.462	QIAGEN NV	9.488.281
140.500	Daifuku Co Ltd	9.293.587
38.894	Zebra Technologies Corp	9.095.493
175.752	FARO Technologies Inc	8.599.141
332.600	Nabtesco Corp	8.544.823
1.039.667	Hiwin Technologies Corp	8.477.368
948.016	Topcon Corp	8.247.496
409.520	Materialise NV ADR	8.172.962
396.883	Ocado Group Plc	7.738.442
126.835	Ambarella Inc	7.660.813
211.900	Yaskawa Electric Corp	7.376.629
17.100	Keyence Corp	7.253.136
564.107	Blue Prism Group plc	7.148.060
48.790	IPG Photonics Corp	7.055.862
37.058	Rockwell Automation Inc	6.958.431
135.601	Cognex Corp	6.932.968
499.369	Airtac International Group	6.685.938
230.820	Nachi-Fujikoshi Corp	6.626.085
111.100	Omron Corp	6.460.474
155.976	Brooks Automation Inc	6.108.807
380.350	Fuji Corp/Aichi	6.022.962
17.557	Illumina Inc	5.794.015
1.136.292	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	5.728.984
95.845	AeroVironment Inc	5.728.598
91.439	Teradyne Inc	5.593.487
102.805	Globus Medical Inc	5.258.723
79.250	Krones AG	5.154.786
11.900	SMC Corp/Japan	5.121.666
31.641	Kardex Holding AG	4.952.550
66.925	Koh Young Technology Inc	4.946.749
15.428	Teledyne Technologies Inc	4.921.052
30.571	Nordson Corp	4.891.423
56.476	Manhattan Associates Inc	4.499.261
261.072	Nuance Communications Inc	4.437.365

## L&G Cyber Security UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
919.332	CrowdStrike Holdings Inc	58.959.442
1.593.209	Fastly Inc	39.664.569
249.703	VMware Inc	34.171.707
1.287.867	Cloudflare Inc	32.380.421
1.625.484	Sailpoint Technologies Holdings Inc	32.152.770
1.375.080	NortonLifeLock Inc	32.063.965
265.059	CyberArk Software Ltd	29.776.236
176.388	General Dynamics Corp	29.386.009
5.405.769	Avast Plc '144A'	28.527.221
537.420	Rapid7 Inc	28.114.011
1.520.647	SolarWinds Corp	27.750.995
313.141	Qualys Inc	27.634.287
718.592	Parsons Corp	27.347.153
320.894	Science Applications International Corp	27.200.489
1.800.491	FireEye Inc	26.044.107
249.262	Fortinet Inc	25.973.044
183.515	Splunk Inc	25.909.099
332.382	Atos SE	25.875.899
563.580	Cisco Systems Inc	25.827.995
216.906	Proofpoint Inc	25.799.725
1.018.310	Ping Identity Holding Corp	25.424.321
1.060.845	Juniper Networks Inc	25.163.602
995.724	NetScout Systems Inc	24.669.158
222.787	Check Point Software Technologies Ltd	24.537.812
66.700	Northrop Grumman Corp	23.586.853
250.128	Akamai Technologies Inc	23.453.164
105.571	Palo Alto Networks Inc	23.001.054
1.194.540	OneSpan Inc	21.523.650
3.253.541	Zix Corp	21.138.736
410.118	Trend Micro Inc/Japan	20.994.958
632.647	ForeScout Technologies Inc	20.989.951
871.412	Radware Ltd	20.656.569
4.061.161	MobileIron Inc	20.082.690
2.060.012	Mitek Systems Inc	19.280.427
1.442.266	Tufin Software Technologies Ltd	19.226.688
143.642	F5 Networks Inc	19.085.347
10.768.012	Fingerprint Cards AB - Class B	18.199.172
367.922	Verint Systems Inc	17.635.489
414.611	Mimecast Ltd	16.922.319
629.079	Tenable Holdings Inc	16.650.745
236.251	Varonis Systems Inc	16.524.693
89.955	Raytheon Co	16.148.204
174.284	Thales SA	16.147.170
253.217	Zscaler Inc	15.690.103
2.257.378	BAE Systems Plc	15.547.194

## L&G Cyber Security UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
2.205.756	A10 Networks Inc	15.233.860
64.269	CACI International Inc - Class A	15.180.820
177.452	Booz Allen Hamilton Holding Corp - Class A	13.060.950
163.507	ManTech International Corp/VA - Class A	12.352.325

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
8.499.747	Sophos Group Plc '144A'	57.426.977
1.304.950	Forescout Technologies Inc	41.976.927
649.583	Rapid7 Inc	34.027.566
299.498	Fortinet Inc	33.455.756
327.545	Akamai Technologies Inc	31.722.990
321.856	Qualys Inc	31.617.974
1.114.377	FFRI Security Inc	30.672.541
400.920	CrowdStrike Holdings Inc	26.492.636
180.977	Splunk Inc	26.370.793
1.917.394	SecureWorks Corp	25.090.955
913.543	Carbon Black Inc	23.677.070
1.067.407	NortonLifeLock Inc	21.688.116
7.551.082	NCC Group Plc	20.278.730
406.520	Ahnlab Inc	20.072.368
167.579	Proofpoint Inc	19.784.025
164.365	CyberArk Software Ltd	19.760.352
780.022	NetScout Systems Inc	19.719.591
405.200	Trend Micro Inc/Japan	19.149.898
1.130.953	OneSpan Inc	18.986.042
11.376.875	Fingerprint Cards AB - Class B	18.965.136
89.955	Raytheon Co	17.864.812
158.440	Check Point Software Technologies Ltd	16.967.165
351.160	Cisco Systems Inc	16.400.249
79.984	VeriSign Inc	15.365.552
2.546.965	Avast Plc '144A'	15.177.353
617.192	Juniper Networks Inc	14.697.400
579.753	Radware Ltd	13.104.784
750.362	FireEye Inc	11.483.636
123.060	Varonis Systems Inc	9.829.940
45.531	Palo Alto Networks Inc	9.614.455
359.835	Sailpoint Technologies Holdings Inc	8.668.398
89.823	Leidos Holdings Inc	8.384.957
35.073	CACI International Inc - Class A	8.343.239

## L&G All Commodities UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Kosten US\$
52.953.070	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	52.953.070
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
50.490.070	Barclays Bank Plc	1,69 %	24.02.2020	50.490.070
50.133.070	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	50.133.070
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
48.635.070	Barclays Bank Plc	1,69 %	24.02.2020	48.635.070
47.984.000	Barclays Bank Plc	2,17 %	24.09.2019	47.984.000
46.348.070	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	46.348.070
45.918.070	Barclays Bank Plc	0,21 %	24.06.2020	45.918.070
45.918.070	Barclays Bank Plc	0,31 %	22.07.2020	45.918.070
43.128.070	Barclays Bank Plc	0,70 %	22.05.2020	43.128.070
39.328.070	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	39.328.070
31.653.070	Barclays Bank Plc	0,96 %	22.04.2020	31.653.070
11.475.000	Barclays Bank Plc	0,96 %	22.04.2020	11.475.000
4.318.000	Barclays Bank Plc	1,70 %	24.02.2020	4.318.000
1.720.000	Barclays Bank Plc	2,21 %	24.09.2019	1.720.000

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits-termin	Erlöse US\$
52.953.070	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	52.953.070
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
50.490.070	Barclays Bank Plc	1,69 %	24.02.2020	50.490.070
50.133.070	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	50.133.070
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
48.635.070	Barclays Bank Plc	1,69 %	24.02.2020	48.635.070
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
46.348.070	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	46.348.070
45.918.070	Barclays Bank Plc	0,21 %	24.06.2020	45.918.070
43.128.070	Barclays Bank Plc	0,70 %	22.05.2020	43.128.070
39.328.070	Barclays Bank Plc	1,66 %	24.03.2020	39.328.070
31.653.070	Barclays Bank Plc	0,96 %	22.04.2020	31.653.070
11.475.000	Barclays Bank Plc	0,96 %	22.04.2020	11.475.000
4.318.000	Barclays Bank Plc	1,70 %	24.02.2020	4.318.000
1.720.000	Barclays Bank Plc	2,21 %	24.09.2019	1.720.000



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

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

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
8.454.553	Barclays Bank Plc	1,70 %	24.02.2020	8.454.553
8.233.000	Barclays Bank Plc	2,21 %	24.09.2019	8.233.000
8.134.553	Barclays Bank Plc	1,70 %	24.02.2020	8.134.553
8.104.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	8.104.553
7.893.000	Barclays Bank Plc	2,30 %	22.08.2019	7.893.000
7.599.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	7.599.553
7.224.553	Barclays Bank Plc	0,30 %	22.07.2020	7.224.553
6.989.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	6.989.553
6.979.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	24.06.2020	6.979.553
6.789.553	Barclays Bank Plc	0,71 %	22.05.2020	6.789.553
6.494.553	Barclays Bank Plc	0,71 %	22.05.2020	6.494.553
6.309.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	6.309.553
5.854.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	5.854.553
4.659.553	Barclays Bank Plc	0,97 %	22.04.2020	4.659.553
1.495.000	Barclays Bank Plc	0,97 %	22.04.2020	1.495.000
340.000	Barclays Bank Plc	2,30 %	22.08.2019	340.000

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

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
8.454.553	Barclays Bank Plc	1,82 %	23.01.2020	8.454.553
8.454.553	Barclays Bank Plc	1,70 %	24.02.2020	8.454.553
8.233.000	Barclays Bank Plc	2,21 %	24.09.2019	8.233.000
8.134.553	Barclays Bank Plc	1,70 %	24.02.2020	8.134.553
8.104.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	8.104.553
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
7.599.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	7.599.553
6.989.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	6.989.553
6.979.553	Barclays Bank Plc	0,21 %	24.06.2020	6.979.553
6.789.553	Barclays Bank Plc	0,71 %	22.05.2020	6.789.553
6.494.553	Barclays Bank Plc	0,71 %	22.05.2020	6.494.553
6.309.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	6.309.553
5.854.553	Barclays Bank Plc	1,67 %	24.03.2020	5.854.553
4.659.553	Barclays Bank Plc	0,97 %	22.04.2020	4.659.553
1.495.000	Barclays Bank Plc	0,97 %	22.04.2020	1.495.000
340.000	Barclays Bank Plc	2,30 %	22.08.2019	340.000

## L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
7.675.597	Galaxy Resources Ltd	4.625.637
3.711.996	Tianneng Power International Ltd	4.475.360
26.075.585	Pilbara Minerals Ltd	4.369.694
240.873	AMG Advanced Metallurgical Group NV	3.889.279
29.549	SolarEdge Technologies Inc	3.883.972
963.270	Nissan Motor Co Ltd	3.880.877
183.479	Renault SA	3.871.368
314.441	Mineral Resources Ltd	3.802.392
163.800	Showa Denko KK	3.705.551
5.594	Tesla Inc	3.692.572
122.600	Brookfield Business Partners LP (Units)	3.574.264
611.131	Aggreko Plc	3.550.742
101.584	Daimler AG	3.497.384
25.537	Honeywell International Inc	3.477.542
9.239	Lockheed Martin Corp	3.450.219
476.593	General Electric Co	3.426.970
198.803	GS Yuasa Corp	3.426.318
12.883	Samsung SDI Co Ltd	3.412.953
279.993	Sumitomo Electric Industries Ltd	3.307.498
73.882	NEC Corp	3.228.212
367.255	Panasonic Corp	3.224.997
217.590	NGK Insulators Ltd	3.184.917
10.299	LG Chem Ltd	3.184.518
561.962	BYD Co Ltd 'H'	3.182.988
110.593	Toshiba Corp	3.149.229
518.728	Livent Corp	3.144.177
51.308	Bayerische Motoren Werke AG	3.138.525
149.379	ABB Ltd	3.057.779
31.357	TDK Corp	2.976.190
45.680	EnerSys	2.958.392
50.117	DMG Mori AG	2.345.728
51.350	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	1.346.083
706.058	Orocobre Ltd	1.322.930

## L&G Battery Value-Chain UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
8.584	Tesla Inc	5.270.664
91.356	Hitachi Chemical Co Ltd	3.654.421
50.966	Sony Corp	3.197.032
31.618	FMC Corp	2.797.284
39.251	Albemarle Corp	2.447.925
192.143	Mitsubishi Electric Corp	2.366.847
54.537	Sanyo Chemical Industries Ltd	2.292.939
50.117	DMG Mori AG	2.222.670
34.006	Nidec Corp	2.222.222
97.916	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	2.215.101
92.836	Evonik Industries AG	2.128.223
21.852	Siemens AG	2.073.482
8.197	Samsung SDI Co Ltd	1.964.743
303.940	BYD Co Ltd 'H'	1.791.201
1.365.868	Orocobre Ltd	1.754.760
39.600	NEC Corp	1.675.036
19.135	SK Innovation Co Ltd	1.601.343
5.066	LG Chem Ltd	1.555.806
15.200	TDK Corp	1.412.042
2.610.316	Dongfang Electric Corp Ltd 'H'	1.411.730
64.244	ABB Ltd	1.277.919
88.000	NGK Insulators Ltd	1.271.906
102.400	Sumitomo Electric Industries Ltd	1.241.099
146.500	Panasonic Corp	1.228.578
69.300	GS Yuasa Corp	1.169.631
18.303	EnerSys	1.138.675
140.913	General Electric Co	1.129.160
37.538	Toshiba Corp	1.073.364
16.486	Bayerische Motoren Werke AG	1.049.654
215.100	Nissan Motor Co Ltd	935.592
1.266.119	Galaxy Resources Ltd	697.935

## L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
335.468	Mallinckrodt Plc	1.083.251
544.294	Mesoblast Ltd	932.193
46.468	Halozyme Therapeutics Inc	931.151
13.445	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	822.368
17.725	Basilea Pharmaceutica AG	808.483
6.440	Sarepta Therapeutics Inc	785.763
10.361	Emergent BioSolutions Inc	754.258
7.152	United Therapeutics Corp	752.096
21.050	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	751.115
10.456	Ipsen SA	748.943
2.245	Roche Holding AG	740.851
38.263	Nektar Therapeutics - Class A	739.792
7.881	Incyte Corp	735.115
12.505	Bristol-Myers Squibb Co	732.496
8.492	AbbVie Inc	730.915
18.011	Horizon Therapeutics Plc	730.332
10.500	Eisai Co Ltd	726.695
37.002	Swedish Orphan Biovitrum AB	722.988
6.781	Alexion Pharmaceuticals Inc	721.171
31.000	Kyowa Kirin Co Ltd	713.823
7.840	Sanofi	713.564
2.698	Vertex Pharmaceuticals Inc	703.519
2.260	Biogen Inc	676.801
4.274	BeiGene Ltd ADR	674.059
26.100	Torii Pharmaceutical Co Ltd	672.228
8.495	Nippon Shinyaku Co Ltd	655.049
7.117	BioMarin Pharmaceutical Inc	653.764
163.946	Endo International Plc	633.006
16.979	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	616.406
7.097	Novartis AG	615.442
11.117	Ionis Pharmaceuticals Inc	613.478
18.817	Grifols SA	611.462
3.051	CSL Ltd	588.569
5.022	Jazz Pharmaceuticals Plc	580.385
11.662	PTC Therapeutics Inc	573.707
18.727	Santen Pharmaceutical Co Ltd	329.080
1.074	Regeneron Pharmaceuticals Inc	323.829
8.690	H Lundbeck A/S	310.663

## L&G Pharma Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
11.209	Array BioPharma Inc	538.032
1.074	Regeneron Pharmaceuticals Inc	482.552
129.083	Mallinckrodt Plc	464.367
8.539	Basilea Pharmaceutica AG	412.233
26.785	Retrophin Inc	368.321
170.947	Pharma Mar SA	362.192
9.176	Horizon Therapeutics Plc	361.447
3.386	Celgene Corp	358.960
7.475	PTC Therapeutics Inc	356.895
1.888	CSL Ltd	354.879
1.338	Vertex Pharmaceuticals Inc	326.355
1.857	BeiGene Ltd ADR	314.802
3.136	BioMarin Pharmaceutical Inc	311.734
5.100	Eisai Co Ltd	306.073
3.630	Ligand Pharmaceuticals Inc	301.446
3.629	Nippon Shinyaku Co Ltd	301.108
1.044	Biogen Inc	298.503
4.688	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	296.550
13.863	Halozyme Therapeutics Inc	291.593
9.086	Grifols SA	284.809
2.747	United Therapeutics Corp	284.541
18.727	Santen Pharmaceutical Co Ltd	278.923
3.920	Emergent BioSolutions Inc	268.417
25.436	BTG Plc	259.397
8.690	H Lundbeck A/S	257.242
11.987	Swedish Orphan Biovitrum AB	246.297
27.770	Spectrum Pharmaceuticals Inc	246.025
2.490	Incyte Corp	230.691
2.443	Novartis AG	217.578
5.850	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	211.886
2.369	Ipsen SA	201.251
1.771	Alexion Pharmaceuticals Inc	199.183
85.660	Mesoblast Ltd	195.281
1.596	Jazz Pharmaceuticals Plc	191.871
3.075	Ionis Pharmaceuticals Inc	184.303
14.387	Bukwang Pharmaceutical Co Ltd	169.315
4.301	Agios Pharmaceuticals Inc	162.308
1.013	Sarepta Therapeutics Inc	160.343
6.022	Nektar Therapeutics - Class A	131.504
4.900	Kyowa Kirin Co Ltd	130.052
3.400	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	130.020
1.338	AbbVie Inc	126.363
1.235	Sanofi	126.321
353	Roche Holding AG	124.547

## L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
110.518	Vipshop Holdings Ltd ADR	1.819.451
80.837	Ocado Group Plc	1.804.228
37.149	JD.com Inc ADR	1.771.410
30.667	Zalando SE '144A'	1.726.386
22.782	Manhattan Associates Inc	1.680.543
40.370	eBay Inc	1.676.902
714	Amazon.com Inc	1.644.812
66.205	Mainfreight Ltd	1.560.973
35.800	Descartes Systems Group Inc/The	1.542.486
14.837	DSV PANALPINA A/S	1.499.327
7.321	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.495.316
12.073	CJ Logistics Corp	1.489.876
58.731	Hitachi Transport System Ltd	1.482.358
20.985	XPO Logistics Inc	1.467.886
15.276	SYNNEX Corp	1.461.654
1.034.064	Kerry Logistics Network Ltd	1.422.637
93.300	Kintetsu World Express Inc	1.422.619
46.186	Deutsche Post AG	1.408.697
1.434	AP Moller - Maersk A/S - Class B	1.408.322
159.000	Rakuten Inc	1.404.814
42.612	Ryder System Inc	1.400.753
78.334	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	1.399.451
28.057	Nippon Express Co Ltd	1.393.394
11.256	Walmart Inc	1.392.896
101.655	Nippon Yusen KK	1.387.744
479.977	Bollore SA	1.387.357
18.857	Expeditors International of Washington Inc	1.378.707
10.831	FedEx Corp	1.376.232
174.276	Senko Group Holdings Co Ltd	1.370.665
11.103	SAP SE	1.358.766
9.280	Kuehne + Nagel International AG	1.345.551
25.029	Oracle Corp	1.325.988
13.130	United Parcel Service Inc - Class B	1.311.057
188.945	bpost SA	1.288.309
167.977	Japan Post Holdings Co Ltd	1.278.347
5.524.679	Sinotrans Ltd 'H'	1.262.028
5.999.313	Li & Fung Ltd	788.303

Vorstehend aufgeführt sind alle Käufe des Fonds im Geschäftsjahr.

## L&G Ecommerce Logistics UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
6.762.119	Li & Fung Ltd	1.026.782
39.157	Vipshop Holdings Ltd ADR	666.976
9.362	JD.com Inc ADR	418.047
3.275	DSV PANALPINA A/S	297.341
121	Amazon.com Inc	272.246
1.111	Alibaba Group Holding Ltd ADR	222.194
1.430	Walmart Inc	177.309
8.469	Ocado Group Plc	149.467
17.800	Senko Group Holdings Co Ltd	134.583
9.700	Kintetsu World Express Inc	131.524
1.006	SAP SE	114.620
2.683	Zalando SE '144A'	108.245
791	Kuehne + Nagel International AG	107.196
1.603	Manhattan Associates Inc	102.909
1.533	Expeditors International of Washington Inc	98.203
1.932	Oracle Corp	95.410
2.600	Descartes Systems Group Inc/The	88.207
1.700	Nippon Express Co Ltd	75.839
688	CJ Logistics Corp	75.515
1.149	XPO Logistics Inc	64.086
4.300	Nippon Yusen KK	55.070
7.700	Rakuten Inc	54.205

## L&G US Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
6.857	Apple Inc	1.983.401
9.250	Microsoft Corp	1.467.541
538	Amazon.com Inc	1.023.421
459	Alphabet Inc	594.581
2.928	Facebook Inc - Class A	576.073
400	Alphabet Inc - Class A	548.917
3.190	Fidelity National Information Services Inc	425.627
3.398	JPMorgan Chase & Co	418.594
1.995	Visa Inc - Class A	372.838
5.853	Bristol-Myers Squibb Co	367.322
2.945	Procter & Gamble Co/The	353.846
1.582	Berkshire Hathaway Inc - Class B	342.729
8.748	AT&T Inc	321.177
1.052	Mastercard Inc	311.393
4.743	Exxon Mobil Corp	302.167
1.096	UnitedHealth Group Inc	291.910
4.876	Verizon Communications Inc	284.590
1.253	Home Depot Inc/The	281.803
1.684	salesforce.com Inc	274.303
4.832	Intel Corp	270.012

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
20.219	Wells Fargo & Co	1.087.705
2.932	Apple Inc	754.052
3.569	Microsoft Corp	553.629
3.451	Celgene Corp	373.282
1.937	Allergan Plc	367.475
182	Amazon.com Inc	349.202
256	Alphabet Inc - Class A	319.486
214	Alphabet Inc	269.633
2.266	JPMorgan Chase & Co	223.686
1.447	Worldpay Inc - Class A	197.025
7.482	Bank of America Corp	189.412
2.459	Anadarko Petroleum Corp	179.003
1.356	Fidelity National Information Services Inc	177.982
3.173	Lennar Corp	172.963
3.874	Cisco Systems Inc	161.322
987	Facebook Inc - Class A	156.122
2.611	Intel Corp	150.476
2.885	CBRE Group Inc - Class A	149.403
2.834	Lennar Corp	147.516
773	Red Hat Inc	146.870



**L&G UK Equity UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten £
21.671	Royal Dutch Shell Plc	380.175
2.393	AstraZeneca Plc	191.018
11.481	GlaxoSmithKline Plc	187.607
41.110	HSBC Holdings Plc	180.153
4.924	British American Tobacco Plc	148.831
43.306	BP Plc	137.356
4.642	Diageo Plc	127.889
6.718	Royal Dutch Shell Plc	111.972
6.015	BHP Group Plc	92.346
2.200	Unilever Plc	91.997
1.424	Reckitt Benckiser Group Plc	91.866
8.650	National Grid Plc	79.261
2.044	Rio Tinto Plc	76.393
3.726	RELX Plc	67.097
54.085	Vodafone Group Plc	65.794
5.507	Prudential Plc	60.851
714	London Stock Exchange Group Plc	54.275
619	Spirax-Sarco Engineering Plc	51.918
811	DCC Plc	51.871
142.353	Lloyds Banking Group Plc	48.068
3.477	Compass Group Plc	46.918
19.166	Tesco Plc	45.748
1.833	Experian Plc	44.902
7.042	BAE Systems Plc	37.328
33.578	Barclays Plc	37.149

**L&G UK Equity UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Erlöse £
4.934	Royal Dutch Shell Plc	77.120
2.175	Royal Dutch Shell Plc	49.372
2.001	BHP Group Plc	35.200
508	DCC Plc	34.202
368	AstraZeneca Plc	26.688
412	Ferguson Plc	24.417
8.543	Investec Plc	23.308
477	Coca-Cola European Partners Plc	21.553
4.431	BP Plc	18.277
514	Diageo Plc	17.001
906	Liberty Global Plc	16.663
3.626	Merlin Entertainments Plc	16.486
736	Liberty Global Plc	16.213
2.576	HSBC Holdings Plc	15.643
932	GlaxoSmithKline Plc	15.451
310	Whitbread Plc	14.893
717	Admiral Group Plc	14.847
2.666	RSA Insurance Group Plc	14.379
4.568	Direct Line Insurance Group Plc	14.017
29.238	Centrica Plc	11.667
1.340	Subsea 7 SA	10.320
1.027	Farfetch Ltd	9.689
1.853	Micro Focus International Plc	8.837
291	British American Tobacco Plc	8.747
1.121	International Consolidated Airlines Group SA	8.053
192	AVEVA Group Plc	7.507
719	National Grid Plc	6.062
140	Rio Tinto Plc	5.873

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
23.000	Toyota Motor Corp	1.531.612
13.800	Sony Corp	863.982
18.000	SoftBank Group Corp	802.831
1.700	Keyence Corp	764.834
21.600	Nippon Telegraph & Telephone Corp	640.184
17.300	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	638.051
117.500	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	566.872
16.900	Recruit Holdings Co Ltd	565.142
16.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	529.755
7.600	Daiichi Sankyo Co Ltd	523.163
1.300	Nintendo Co Ltd	500.108
18.800	Honda Motor Co Ltd	497.861
4.400	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	482.922
15.800	KDDI Corp	451.589
5.700	Kao Corp	448.977
2.400	FANUC Corp	439.959
17.200	Mitsubishi Corp	420.528
3.000	Daikin Industries Ltd	416.859
4.500	Nidec Corp	408.310
4.700	Hoya Corp	407.930

## L&G Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
10.200	Toyota Motor Corp	665.270
9.900	SoftBank Group Corp	456.478
6.400	Sony Corp	416.875
900	Keyence Corp	375.091
10.700	Nippon Telegraph & Telephone Corp	344.550
2.400	Oriental Land Co Ltd/Japan	341.780
7.400	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	276.217
1.400	FANUC Corp	253.175
3.100	Daiichi Sankyo Co Ltd	246.346
600	Nintendo Co Ltd	245.348
500	SMC Corp/Japan	242.512
7.600	Recruit Holdings Co Ltd	241.086
51.600	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	240.681
2.100	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	236.728
1.100	Tokyo Electron Ltd	227.006
8.000	NTT DOCOMO Inc	220.460
2.700	Kao Corp	217.097
9.400	Mitsubishi Corp	214.453
7.400	KDDI Corp	212.468
7.900	Honda Motor Co Ltd	211.728
58.300	Z Holdings Corp	203.508
2.900	Nidec Corp	202.372

**L&G Global Equity UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
784	Apple Inc	229.933
970	Berkshire Hathaway Inc - Class B	189.945
1.053	Microsoft Corp	169.978
1.299	Medtronic Plc	133.109
68	Amazon.com Inc	126.697
6.363	AXA SA	123.572
635	Facebook Inc - Class A	115.302
92	Alphabet Inc	114.300
14.745	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	105.985
2.658	Diageo Plc	88.889
2.164	Comcast Corp	86.056
687	Texas Instruments Inc	76.795
1.428	Mondelez International Inc	75.492
1.127	Bayer AG	75.023
650	Groupe Bruxelles Lambert SA	68.141
483	Fidelity National Information Services Inc	66.818
942	Bristol-Myers Squibb Co	58.274
384	United Technologies Corp	57.396
8.716	BP Plc	54.671
273	CSL Ltd	54.370

## L&G Global Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
2.969	Wells Fargo & Co	159.721
878	Berkshire Hathaway Inc - Class B	144.428
989	Groupe Bruxelles Lambert SA	101.813
1.223	Bayerische Motoren Werke AG	91.792
200	Fairfax Financial Holdings Ltd	91.533
60	Alphabet Inc	64.025
859	Medtronic Plc	63.753
4.242	AXA SA	61.468
464	Celgene Corp	50.189
853	Investor AB	49.071
8.682	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	46.422
230	Allergan Plc	44.385
194	Apple Inc	43.322
433	Texas Instruments Inc	42.926
983	Mondelez International Inc	42.770
807	Bayer AG	41.241
1.188	Comcast Corp	40.898
265	Facebook Inc - Class A	39.370
426	United Parcel Service Inc - Class B	39.147
1.449	Diageo Plc	37.031
266	Microsoft Corp	36.168
781	ASX Ltd	34.918
18	Amazon.com Inc	34.249
253	Fidelity National Information Services Inc	34.001
2.900	Sumitomo Corp	33.472
245	Worldpay Inc - Class A	33.363
451	Anadarko Petroleum Corp	32.830
600	National Bank of Canada	31.250
620	SS&C Technologies Holdings Inc	27.408
1.083	Axalta Coating Systems Ltd	25.387
576	Kirkland Lake Gold Ltd	25.065

**L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten €
8.124	Prosus NV	512.704
5.677	Nestle SA	499.907
9.629	Alcon Inc	499.621
1.512	Roche Holding AG	436.072
9.239	Bayerische Motoren Werke AG - Preference	386.290
28.345	Assicurazioni Generali SpA	381.348
5.315	Novartis AG	379.608
4.943	Anheuser-Busch InBev SA/NV	351.601
2.739	SAP SE	281.498
1.018	ASML Holding NV	245.017
1.069	Teleperformance	239.865
2.383	Just Eat Takeaway.com NV '144A'	233.498
2.002	Air Liquide SA	224.797
640	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	203.930
2.282	Delivery Hero SE '144A'	195.623
4.987	Cellnex Telecom SA '144A'	188.019
612	Zurich Insurance Group AG	182.150
1.238	Allianz SE	178.381
15.784	Epiroc AB	171.988
21.363	Iberdrola SA	164.272
1.991	Schneider Electric SE	156.589
1.990	Sanofi	155.607
11.309	Deutsche Telekom AG	154.894
2.647	Bayer AG	150.843

## L&G Europe ex UK Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse €
6.453	Nestle SA	633.966
5.247	Novartis AG	434.881
7.533	Bayerische Motoren Werke AG	380.288
1.261	Roche Holding AG	334.280
24.555	Assicurazioni Generali SpA	332.235
1.421	Allianz SE	282.345
5.762	TOTAL SA	257.185
606	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	233.231
1.734	Air Liquide SA	217.825
2.690	Sanofi	209.855
22.849	Iberdrola SA	209.409
1.768	SAP SE	206.643
17.290	Epiroc AB	190.650
778	ASML Holding NV	183.547
13.244	Engie SA	180.714
7.767	AXA SA	175.221
1.184	Safran SA	168.940
3.091	Unilever NV	163.749
3.028	Novo Nordisk A/S	152.885
458	Roche Holding AG	146.291
1.494	Siemens AG	145.781
3.580	Investor AB	145.712
1.268	Aena SME SA '144A'	144.858
408	Zurich Insurance Group AG	143.882
2.827	Daimler AG	140.373



## L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
194.200	AIA Group Ltd	1.856.847
28.928	Commonwealth Bank of Australia	1.385.377
7.159	CSL Ltd	1.346.232
46.825	BHP Group Ltd	1.090.578
57.391	Westpac Banking Corp	836.986
22.300	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	747.008
44.971	National Australia Bank Ltd	666.048
39.934	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	583.254
74.185	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	529.778
6.086	Macquarie Group Ltd	503.272
28.900	DBS Group Holdings Ltd	472.656
17.822	Woolworths Group Ltd	440.414
27.300	United Overseas Bank Ltd	440.306
15.909	Wesfarmers Ltd	417.852
178.869	Telstra Corp Ltd	410.609
41.508	Transurban Group	385.372
6.032	Rio Tinto Ltd	354.183
45.000	CK Hutchison Holdings Ltd	349.925
32.131	Goodman Group (REIT)	305.683
31.100	Link REIT (Units) (REIT)	304.328
29.000	CLP Holdings Ltd	299.305
22.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	296.747
152.623	Geely Automobile Holdings Ltd	279.979

## L&G Asia Pacific ex Japan Equity UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
29.661	Ancor Plc CDI	291.271
14.200	AIA Group Ltd	132.459
2.236	Commonwealth Bank of Australia	96.615
11.500	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	82.874
5.100	DBS Group Holdings Ltd	80.723
4.615	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	80.720
2.300	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	76.285
23.000	Singapore Airlines Ltd	70.927
9.000	CK Hutchison Holdings Ltd	68.421
3.700	United Overseas Bank Ltd	62.369
9.270	Dexus (Units) (REIT)	61.809
1.073	Rio Tinto Ltd	61.682
34.067	Scentre Group (REIT)	60.364
764	Macquarie Group Ltd	59.105
301	CSL Ltd	57.716
21.400	CapitaLand Ltd	57.599
9.333	Tpg Corp Ltd Npv	57.116
5.000	CLP Holdings Ltd	51.782
5.491	Transurban Group	50.897
9.000	MTR Corp Ltd	50.187
18.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	38.559
1.590	Woolworths Group Ltd	38.138
6.400	UOL Group Ltd	37.442
38.510	Evergrande Health Industry Group Ltd	37.367
8.839	Hysan Development Co Ltd	35.774
9.000	Henderson Land Development Co Ltd	35.084
22.000	HKT Trust & HKT Ltd	33.795
24.500	Fosun International Ltd	33.411
1.276	BHP Group Ltd	33.056
6.800	Sands China Ltd	33.017
10.880	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	31.046
5.000	Wheelock & Co Ltd	30.587
4.776	Suncorp Group Ltd	29.360
1.665	Sonic Healthcare Ltd	28.496
2.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	28.478
2.141	AGL Energy Ltd	28.384

## L&G Clean Water UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
38.736	United Utilities Group Plc	448.694
17.140	AquaVenture Holdings Ltd	447.956
28.480	National Oilwell Varco Inc	426.381
15.849	Rexnord Corp	419.967
13.286	Severn Trent Plc	410.126
10.625	Advanced Drainage Systems Inc	405.806
956	Geberit AG	393.649
803	Eurofins Scientific SE	392.543
2.193	Rockwell Automation Inc	390.212
25.723	Aegion Corp - Class A	380.997
40.772	Kemira Oyj	379.275
11.548	HD Supply Holdings Inc	376.999
9.916	York Water Co/The	373.332
16.901	Northwest Pipe Co	369.718
5.863	Arkema SA	369.197
6.132	Badger Meter Inc	358.417
9.080	AO Smith Corp	358.305
2.341	Danaher Corp	357.284
18.847	Evoqua Water Technologies Corp	356.835
73.394	Metso Outotec Oyj	348.921
6.309	Franklin Electric Co Inc	347.024
12.984	Halma Plc	341.619
2.747	American Water Works Co Inc	340.768
451	Mettler-Toledo International Inc	331.737
3.312	Lindsay Corp	331.196
36.465	Energy Recovery Inc	330.371
5.097	Middlesex Water Co	327.945
7.947	Trimble Inc	327.624
3.891	Tetra Tech Inc	324.421
8.412	Pentair Plc	320.875
10.484	Ingevity Corp	320.729
8.419	SPX FLOW Inc	320.010
15.163	Aalberts NV	317.271
13.054	Alfa Laval AB	313.899
3.991	Xylem Inc/NY	313.381
1.205	IDEXX Laboratories Inc	307.805
4.615	SJW Group	305.626
6.449	Essential Utilities Inc	305.595
854	Roper Technologies Inc	303.659
5.399	LANXESS AG	303.299
1.592	Ecolab Inc	302.008
3.153	Watts Water Technologies Inc - Class A	299.341
27.435	Mueller Water Products Inc - Class A	298.967
5.673	California Water Service Group	296.682
2.948	Kadant Inc	296.596

**L&G Clean Water UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
5.287	Organo Corp	295.113
28.761	Cadiz Inc	292.753
3.141	Sulzer AG	290.402
10.074	Kurita Water Industries Ltd	289.891
3.590	Itron Inc	284.433
21.143	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR	281.168
17.192	Sekisui Chemical Co Ltd	270.522
3.494	Crane Co	263.958
13.601	Atkore International Group Inc	262.646
1.595	IDEX Corp	261.560
68.127	Rotork Plc	261.022
126.905	Guangdong Investment Ltd	257.811
306.260	China Water Affairs Group Ltd	247.036
1.162	Waters Corp	246.077
6.589	METAWATER Co Ltd	243.668
46.657	Exterran Corp	234.032
8.743	Gorman-Rupp Co/The	222.980
15.646	Consolidated Water Co Ltd	222.586
480.765	Beijing Enterprises Water Group Ltd	222.004

## L&G Clean Water UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
18.083	AquaVenture Holdings Ltd	484.187
17.550	Rexnord Corp	357.907
9.954	AO Smith Corp	350.969
12.589	HD Supply Holdings Inc	322.557
7.117	Severn Trent Plc	176.885
360	Eurofins Scientific SE	174.397
429	Geberit AG	173.942
18.336	United Utilities Group Plc	167.248
11.544	Aegion Corp - Class A	165.457
6.453	Advanced Drainage Systems Inc	164.131
18.298	Kemira Oyj	162.010
4.450	York Water Co/The	161.632
2.631	Arkema SA	156.982
7.584	Northwest Pipe Co	156.334
1.459	American Water Works Co Inc	146.649
1.134	Danaher Corp	140.866
1.940	Tetra Tech Inc	135.931
20.366	Energy Recovery Inc	134.407
6.717	Aalberts NV	130.958
2.875	Badger Meter Inc	128.227
4.644	Ingevity Corp	126.290
175.000	China Water Affairs Group Ltd	123.514
188	Mettler-Toledo International Inc	116.911
5.460	Halma Plc	114.746
13.561	Uponor Oyj	111.829
6.025	Atkore International Group Inc	109.968
2.446	Franklin Electric Co Inc	109.023
556	IDEXX Laboratories Inc	107.996
864	Rockwell Automation Inc	106.899
1.891	Middlesex Water Co	106.415
20.668	Exterran Corp	97.387
6.931	Consolidated Water Co Ltd	96.332
1.102	Lindsay Corp	95.238
1.807	SJW Group	94.955
3.873	Gorman-Rupp Co/The	93.383
1.187	Watts Water Technologies Inc - Class A	91.273
1.520	Xylem Inc/NY	90.073
627	Ecolab Inc	87.839
1.695	California Water Service Group	84.892
2.362	Essential Utilities Inc	80.304
289	Roper Technologies Inc	80.183
3.310	Pentair Plc	77.166
8.312	Evoqua Water Technologies Corp	76.729

## L&G Artificial Intelligence UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
22.899	iRobot Corp	1.665.652
7.260	Veeva Systems Inc - Class A	1.528.756
9.907	Alteryx Inc - Class A	1.456.205
6.950	Wix.com Ltd	1.444.838
7.437	Twilio Inc - Class A	1.407.293
7.644	Splunk Inc	1.390.020
3.907	Illumina Inc	1.385.546
59.740	Nuance Communications Inc	1.384.537
562	Amazon.com Inc	1.366.281
6.240	MongoDB Inc	1.364.223
7.639	Atlassian Corp Plc	1.355.008
7.568	salesforce.com Inc	1.351.477
6.511	HubSpot Inc	1.337.390
3.954	NVIDIA Corp	1.336.320
23.827	Tencent Holdings Ltd	1.321.190
11.482	Baidu Inc ADR	1.311.545
906	Alphabet Inc - Class A	1.299.024
63.531	Appen Ltd	1.298.863
7.054	Microsoft Corp	1.294.434
43.612	Cloudflare Inc	1.283.172
3.103	Fair Isaac Corp	1.270.002
1.758	Shopify Inc	1.255.357
9.906	International Business Machines Corp	1.250.656
5.281	Arista Networks Inc	1.216.055
10.497	Analog Devices Inc	1.213.869
7.057	Dassault Systemes SE	1.212.432
76.235	Blue Prism Group plc	1.212.247
24.147	Rapid7 Inc	1.200.973
13.911	Zendesk Inc	1.188.444
2.826	Netflix Inc	1.183.452
46.263	Veracyte Inc	1.180.288
7.046	Verisk Analytics Inc - Class A	1.178.885
17.629	New Relic Inc	1.173.645
12.869	Xilinx Inc	1.173.249
13.699	Varonis Systems Inc	1.173.184
6.418	Spotify Technology SA	1.169.471
5.379	Autodesk Inc	1.164.918
27.192	Yandex NV - Class A	1.153.733
19.544	Grubhub Inc	1.138.025
3.006	ServiceNow Inc	1.132.863
21.181	JD.com Inc ADR	1.128.576
5.504	Accenture Plc - Class A	1.114.659
3.833	Intuit Inc	1.103.425
11.386	Etsy Inc	1.087.008
3.780	Lam Research Corp	1.084.133
3.276	ASML Holding NV NY Reg Shrs	1.071.703
1.253	Tesla Inc	1.064.077

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

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
5.032	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.062.191
4.519	Palo Alto Networks Inc	1.059.327
12.366	Square Inc	1.034.340
1.234	MercadoLibre Inc	1.030.189
18.047	Cognex Corp	1.009.519
8.552	Proofpoint Inc	991.933
7.980	Electronic Arts Inc	977.612
9.106	Fiserv Inc	965.504
43.742	Infineon Technologies AG	964.473
2.405	Adobe Inc	935.625
8.473	Aspen Technology Inc	913.612
8.441	Capgemini SE	903.053
22.486	Cornerstone OnDemand Inc	896.580
12.820	Teradyne Inc	883.595
98.664	Sage Group Plc/The	859.033
514	Booking Holdings Inc	857.901

**L&G Artificial Intelligence UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
101.682	Sage Group Plc/The	868.965
15.932	SoftBank Group Corp	803.068
103.851	Global Unichip Corp	760.246
33.380	Teradata Corp	678.016
2.787	Twilio Inc - Class A	568.005
7.045	iRobot Corp	555.010
15.610	Publicis Groupe SA	510.078
1.673	Wix.com Ltd	363.332
459	Shopify Inc	338.560
10.072	Appen Ltd	228.156
846	Veeva Systems Inc - Class A	187.076
588	NVIDIA Corp	172.696
2.934	JD.com Inc ADR	162.904
181	MercadoLibre Inc	159.107
556	Autodesk Inc	124.513
687	Splunk Inc	118.726
45	Amazon.com Inc	108.085
218	Tesla Inc	104.698
5.098	Intellia Therapeutics Inc	102.809
440	MongoDB Inc	87.209



## L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF

### Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
2.772	Insulet Corp	528.285
30.143	Collectis SA ADR	520.689
13.206	Livongo Health Inc	510.221
45.772	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd '144A'	507.792
23.324	Vocera Communications Inc	501.871
3.115	DiaSorin SpA	501.732
8.455	Tabula Rasa HealthCare Inc	499.211
4.026	Quidel Corp	496.055
3.500	Teladoc Health Inc	478.120
7.095	Novocure Ltd	474.422
11.854	Natera Inc	467.920
15.944	NeoGenomics Inc	464.465
2.488	ABIOMED Inc	455.492
2.588	Penumbra Inc	455.108
12.151	Boston Scientific Corp	453.393
5.575	Exact Sciences Corp	451.109
1.419	Illumina Inc	448.373
44.278	Axogen Inc	443.983
10.334	Glaukos Corp	443.973
6.782	Catalent Inc	441.934
3.562	Varian Medical Systems Inc	441.368
782	Intuitive Surgical Inc	434.060
1.297	Thermo Fisher Scientific Inc	430.245
20.738	Nuance Communications Inc	429.363
2.622	Charles River Laboratories International Inc	427.997
11.628	STAAR Surgical Co	427.388
5.876	Omniceil Inc	426.679
1.403	DexCom Inc	425.474
8.430	Integra LifeSciences Holdings Corp	423.815
4.151	iRhythm Technologies Inc	418.590
2.911	IQVIA Holdings Inc	417.040
2.591	Danaher Corp	414.369
10.731	Cardiovascular Systems Inc	412.116
8.990	Siemens Healthineers AG '144A'	411.449
4.538	Medpace Holdings Inc	405.347
3.229	Nevro Corp	402.534
4.661	Incyte Corp	402.164
16.103	Veracyte Inc	401.470
1.249	Tecan Group AG	401.151
21.046	Invitae Corp	400.319
894	Lonza Group AG	399.612
12.787	NanoString Technologies Inc	393.027
914	Bio-Rad Laboratories Inc	382.891
1.094	Roche Holding AG	381.614
798	Regeneron Pharmaceuticals Inc	380.684
2.434	Edwards Lifesciences Corp	374.387

**L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft) (Fortsetzung)**

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
8.342	Koninklijke Philips NV	373.998
15.649	CryoLife Inc	367.513
7.889	BioTelemetry Inc	364.033
1.794	CSL Ltd	361.768
17.695	Materialise NV ADR	360.943
11.037	Grifols SA	358.995
629	Eurofins Scientific SE	352.546
29.602	Codexis Inc	350.056
3.805	PerkinElmer Inc	347.726
1.319	Vertex Pharmaceuticals Inc	342.679
1.650	Masimo Corp	337.327
4.070	Agilent Technologies Inc	334.791
6.724	Hologic Inc	334.088
6.806	Tactile Systems Technology Inc	333.111
1.447	Align Technology Inc	330.807
1.705	Stryker Corp	329.656

**L&G Healthcare Breakthrough UCITS ETF****Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
8.894	Livongo Health Inc	626.359
2.480	Teladoc Health Inc	429.274
942	DexCom Inc	330.333
1.768	Quidel Corp	325.141
9.760	HMS Holdings Corp	299.935
2.456	iRhythm Technologies Inc	280.282
4.831	PeptiDream Inc	235.272
2.620	Moderna Inc	173.824
618	ABIOMED Inc	158.870
829	DiaSorin SpA	153.900
4.194	QIAGEN NV	153.322
12.989	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd '144A'	145.901
6.448	Materialise NV ADR	138.157
2.279	STAAR Surgical Co	111.906
1.545	Catalent Inc	109.223
1.214	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	71.254
5.590	Myriad Genetics Inc	70.485
2.870	Intellia Therapeutics Inc	59.380
288	Veeva Systems Inc - Class A	56.673
584	Exact Sciences Corp	53.370
122	Regeneron Pharmaceuticals Inc	52.419

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

Nominal	Bezeichnung	Kosten €
92.946	Nestle SA	9.481.347
21.779	Roche Holding AG	5.546.516
639.599	HSBC Holdings Plc	4.206.797
32.859	SAP SE	3.631.686
40.658	AstraZeneca Plc	3.329.354
8.259	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	3.079.282
153.749	GlaxoSmithKline Plc	2.942.859
16.879	Linde Plc	2.889.595
74.363	Diageo Plc	2.870.119
13.178	ASML Holding NV	2.856.922
34.887	Sanofi	2.840.456
13.220	Allianz SE	2.664.617
46.177	Unilever NV	2.577.175
51.740	Novo Nordisk A/S	2.498.094
24.049	Siemens AG	2.238.499
30.624	Bayer AG	2.054.168
27.625	Novartis AG	2.004.701
34.628	Unilever Plc	1.986.917
23.896	Anheuser-Busch InBev SA/NV	1.970.319
7.647	L'Oreal SA	1.943.521

**Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)**

Nominal	Bezeichnung	Erlöse €
55.058	Nestle SA	4.773.756
12.572	Roche Holding AG	3.504.082
369.063	HSBC Holdings Plc	1.898.784
18.809	SAP SE	1.690.579
24.015	AstraZeneca Plc	1.663.529
7.612	ASML Holding NV	1.659.545
20.077	Sanofi	1.538.738
30.240	Novo Nordisk A/S	1.477.633
4.745	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1.415.795
9.855	Linde Plc	1.383.012
87.919	GlaxoSmithKline Plc	1.367.697
43.178	Diageo Plc	1.132.822
27.058	Unilever NV	1.125.125
7.822	Allianz SE	1.047.125
28.321	TOTAL SE	1.010.443
4.516	L'Oreal SA	960.239
27.012	British American Tobacco Plc	937.326
110.469	Iberdrola SA	915.122
13.804	Siemens AG	913.580
244.170	BP Plc	850.792

\* Der Fonds wurde am 30. August 2019 aufgelegt.

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

Nominal	Bezeichnung	Kosten US\$
166.812	Apple Inc	46.457.385
281.251	Microsoft Corp	44.837.808
15.730	Amazon.com Inc	30.121.358
89.297	Facebook Inc - Class A	18.099.601
12.182	Alphabet Inc	16.325.450
116.998	JPMorgan Chase & Co	14.887.087
10.836	Alphabet Inc - Class A	14.525.805
63.679	Visa Inc - Class A	11.846.611
93.450	Procter & Gamble Co/The	11.254.922
51.469	Berkshire Hathaway Inc - Class B	11.215.119
343.334	Bank of America Corp	10.983.080
273.028	AT&T Inc	9.994.065
35.230	UnitedHealth Group Inc	9.863.985
33.008	Mastercard Inc	9.735.889
163.261	Intel Corp	9.666.360
67.424	Walt Disney Co/The	9.522.825
40.558	Home Depot Inc/The	9.102.206
155.370	Verizon Communications Inc	9.095.911
159.575	Coca-Cola Co/The	8.593.163
95.574	Merck & Co Inc	8.036.045

\* Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

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

Nominal	Bezeichnung	Erlöse US\$
59.004	Apple Inc	15.096.412
10.836	Alphabet Inc - Class A	14.372.830
95.210	Microsoft Corp	14.062.340
5.196	Amazon.com Inc	9.439.795
4.345	Alphabet Inc	5.033.141
29.888	Facebook Inc - Class A	4.571.886
41.888	JPMorgan Chase & Co	4.063.403
31.917	Procter & Gamble Co/The	3.780.822
21.846	Visa Inc - Class A	3.495.874
95.771	AT&T Inc	3.244.106
16.931	Berkshire Hathaway Inc - Class B	3.186.991
127.022	Bank of America Corp	2.955.244
58.159	Intel Corp	2.952.868
11.841	UnitedHealth Group Inc	2.925.869
52.305	Verizon Communications Inc	2.856.804
11.216	Mastercard Inc	2.716.465
53.423	Coca-Cola Co/The	2.541.097
32.769	Merck & Co Inc	2.466.987
13.858	Home Depot Inc/The	2.453.848
17.840	PepsiCo Inc	2.287.575

\* Der Fonds wurde am 26. November 2019 aufgelegt.

