



# Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

IE00BMDPBZ72

Fund Fact Sheet | Renta Variable | 30 abril 2023

**Solo para clientes profesionales. No apto para la distribución a clientes minoristas.**

## Datos del Fondo

Divisa Base	USD
Patrimonio (USD)	131 millones
Fecha de Lanzamiento	29.07.2020
Índice subyacente	S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Index-NR
Universo de inversión	S&P 500 Index-NR
ISIN	IE00BMDPBZ72
Total Expense Ratio*	0,07
Domicilio	Irlanda
OICVM	Sí
Metodología	Full Replication
Estructura del producto	Física
Frecuencia de recomposición del índice	Trimestral
Uso de ingresos	Acumulación
Fin del ejercicio fiscal	30 junio
Acciones en circulación	3,950,000
Símbolo de índice subyacente	SP50PAUN
Categoría conforme al SFDR de la UE	Artículo 8

## Resumen de los Objetivos de Inversión

El Fondo ofrece exposición a valores de gran capitalización de EE.UU. Alineados con la transición de bajas emisiones de carbono y busca rastrear el rendimiento del S&P500 Net Zero 2050 ESG Index-NR alineado con París (el "Índice Subyacente") lo más cerca posible, independientemente de si el nivel del índice subyacente sube o baja.

## Gestión del Fondo

Dina Ting, CFA: Estados Unidos  
Lorenzo Crosato, CFA: Reino Unido

Los gastos son las comisiones que el Fondo cobra a los inversores para cubrir los costes de funcionamiento del Fondo. También se incurrirá en costes adicionales, incluidas las comisiones de las transacciones. Estos costes son pagados por el Fondo, lo que repercutirá en la rentabilidad global del mismo.

Los gastos del Fondo se efectuarán en varias divisas, lo que significa que los pagos podrían aumentar o disminuir como consecuencia de las fluctuaciones de los tipos de cambio.

## Motivos para invertir

- Ofrece exposición diversificada a renta variable estadounidense conforme con los objetivos y las metas del Acuerdo de París
- Permite a los inversores gestionar los riesgos del cambio climático y acceder a las oportunidades de la transición a unas bajas emisiones de carbono
- Acceso a una inversión que pretende seguir los índices de referencia climáticos estandarizados de la UE

## Rentabilidad

**La rentabilidad pasada no puede predecir rentabilidades futuras.**

**Desde lanzamiento en Divisa de la Clase de Acción (%)**

■ Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF



## Rentabilidad en Divisa de la Clase de Acción (%)

	Acumulada					
	1 Mes	3 Meses	6 Meses	En el año	1 Año	Desde Lanz.
S&P 500 Index-NR en USD	1,53	2,59	8,35	9,00	2,13	31,89
S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Index-NR en USD	1,22	2,56	9,91	10,31	2,71	31,43

La rentabilidad del Fondo puede aumentar o disminuir como consecuencia de las fluctuaciones del tipo de cambio de divisas. **El valor de las acciones del Fondo y de los ingresos que se reciban de él pueden tanto subir como bajar, y los inversores podrían no recuperar todo el capital invertido.** Todos los datos de rentabilidad mostrados se expresan en la divisa indicada e incluyen los dividendos reinvertidos, una vez descontadas las comisiones de gestión. Los gastos de suscripción, así como otras comisiones, impuestos y costes relevantes pagados por el inversor no están incluidos en los cálculos. El fondo ofrece otras clases de acciones que están sujetas a comisiones y gastos distintos, lo cual afectará a su rentabilidad.

Las referencias a índices se incluyen sólo con fines comparativos y se facilitan para representar el entorno de inversión que prevalecía durante los periodos de tiempo indicados. Una vez se ha convertido la rentabilidad para la cartera o su índice de referencia, se pueden usar tipos de cambio de cierre de divisas entre la cartera y su índice de referencia.

## 10 Principales Posiciones (% del Total)

Nombre del emisor	% del Total
MICROSOFT CORP	5,98
ALPHABET INC	4,92
APPLE INC	4,71
AMAZON.COM INC	4,50
NVIDIA CORP	3,51
VISA INC	1,91
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,81
JPMORGAN CHASE & CO	1,66
ABBVIE INC	1,65
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,55

## Medidas del Fondo

	Fondo	Universo de inversión
Precio para ganancias (12 meses rezagado)	23,72x	23,05x
Precio Valor Contable	4,07x	4,08x
Número de Posiciones	314	503
Rentabilidad por Dividendo	1,50%	1,62%
ROE	24,37%	22,97%
Desviación Estándar (1 Año)	22,07%	21,08%
Ratio Sharpe (1 Año)	-0,01	-0,05
Tracking Error (1 Año)	1,92%	ND
Ratio de Información (1 Año)	0,39	ND

## Información sobre operaciones

Cambio	Símbolo	Divisa comercial	Bloomberg ID	ID Reuters	Código SEDOL
Borsa Italiana	USPA	EUR	USPA IM	USPA.MI	BMXB1X3
Deutsche Börse Xetra	FLX5	EUR	FLX5 GY	FLX5.DE	BMXB1W2
Euronext Amsterdam Exchange	USPA	EUR	USPA NA	FLX5.AS	BKY8CX6
London Stock Exchange	USPA	USD	USPA LN	USPA.L	BMXB1X3
London Stock Exchange	500P	GBP	500P LN	500P.L	BMXB1V1
SIX Swiss Exchange	USPA	USD	USPA SW	USPA.S	BMXB1Y4

\*El Cargo Corriente del Franklin S&P500 Paris Aligned Climate UCITS ETF incluye una exención de comisiones del 0,08% hasta el 31 de mayo de 2023. La exención de Cargo Corriente expirará a partir del 1 de julio de 2023. Se puede encontrar más información en la sección "Comisiones y Gastos" del Prospecto.

**Solo para clientes profesionales. No apto para la distribución a clientes minoristas.****Composición del Fondo**

■ Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF ■ S&P 500 Index-NR

**Área Geográfica**

	% del Total
Estados Unidos	99,77 / 100,00
Liquidez	0,23 / 0,00

**Distribución por capitalización en USD**

	% De Renta Variable
<2,0 Mil Millones	0,02
2,0-5,0 Mil Millones	0,02
5,0-10,0 Mil Millones	1,10
10,0-25,0 Mil Millones	9,89
25,0-50,0 Mil Millones	12,30
>50,0 Mil Millones	76,67
ND	0,01

**Sectorial**

	% del Total
Tecnologías de la Información	25,58 / 25,81
Financiero	16,51 / 13,10
Sanitario	15,91 / 14,41
Consumo Discrecional	11,56 / 9,99
Industriales	8,91 / 8,43
Servicios de comunicación	8,36 / 8,28
Bienes de Primera Necesidad	7,17 / 7,38
Inmobiliario	3,02 / 2,54
Materiales	2,09 / 2,60
Otros	0,66 / 7,56
Liquidez	0,23 / 0,00

**¿Cuáles son los principales riesgos?**

El Fondo brinda exposición a instrumentos financieros emitidos por compañías de gran capitalización bursátil de EE.UU. y busca seguir el desempeño del S&P 500 Paris-Aligned Climate Index (el «Índice Subyacente») tan estrechamente como sea posible, independientemente de si el nivel del Índice Subyacente suba o baja. Brinda exposición diversificada a acciones de EE.UU. alineadas con los objetivos y metas del acuerdo de París. Posibilita que los inversores reduzcan los riesgos del cambio climático y accedan a oportunidades de inversión en la transición hacia una economía con bajas emisiones de carbono. Busca seguir los índices de referencia climáticos estandarizados de la Unión Europea. El Fondo tiene la intención de seguir el desempeño del Índice, que está construido con acciones de gran capitalización de EE.UU. seleccionadas del Índice Principal. Tales activos han estado, históricamente, sujetos a movimientos de precios debido a factores tales como la volatilidad general del mercado de acciones, cambios en las perspectivas financieras, o fluctuaciones en los mercados cambiarios. Como resultado, el desempeño del Fondo puede fluctuar significativamente en períodos relativamente cortos. Otros riesgos significativos incluyen: riesgo de contraparte, riesgo cambiario, riesgo de instrumentos derivados, riesgo relacionado con el índice y riesgo de negociación en el mercado secundario. Standard & Poor's® y S&P son marcas registradas de Standard & Poor's Financial Services LLC (S&P); Dow Jones es una marca registrada de Dow Jones Trademark Holdings LLC (Dow Jones); y estas marcas comerciales han sido licenciadas para uso de S&P Dow Jones Indices LLC (SPDJ) y sub-licenciadas para ciertos propósitos por Franklin Templeton. Los productos financieros de Franklin Templeton no están patrocinados, respaldados, vendidos ni promovidos por la SPDJI, Dow Jones, S&P, sus respectivas filiales y terceros otorgantes de licencias y ninguna de esas partes hace declaración alguna con respecto a la conveniencia de invertir en dicho(s) producto(s) ni tiene ninguna responsabilidad en relación con el mismo, incluso por cualquier error, omisión o interrupción de cualquier índice.

**Información importante**

**Este fondo se ha clasificado conforme al artículo 8 del Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros. Este tipo de fondos cuentan con un enfoque de integración ESG y, además, tienen características ambientales y sociales obligatorias en su proceso de inversión.** Puede encontrar más información sobre los aspectos relacionados con la sostenibilidad del Fondo en [www.franklinresources.com/countries](http://www.franklinresources.com/countries). Antes de invertir, revise todos los objetivos y características del Fondo.

La fuente de los datos e información facilitados por Franklin Templeton corresponde a la que está vigente en la fecha de este documento, a menos que se indique lo contrario. La finalidad de este material es satisfacer el interés general, por lo que no deberá interpretarse como un asesoramiento de inversión individual ni como una recomendación o invitación para comprar, vender o mantener valor alguno o adoptar cualquier estrategia de inversión. No constituye un asesoramiento jurídico ni fiscal.

Los valores del principal y la rentabilidad de las inversiones en Franklin Templeton ICAV (el «ETF») cambiarán en función de las condiciones del mercado, de modo que los inversores pueden experimentar ganancias o pérdidas al vender las acciones. Visite la web [www.libertyshares.co.uk](http://www.libertyshares.co.uk) para consultar el rendimiento de final de mes estandarizado y más reciente de Franklin Templeton ICAV. No existe garantía alguna de que una estrategia determinada vaya a lograr su objetivo. La inversión en Franklin Templeton ICAV no está exenta de riesgos, de modo que los inversores pueden perder dinero.

Todos los datos de rentabilidad se muestran en la divisa base del fondo. Los datos de rentabilidad se basan en el valor liquidativo (NAV) del ETF que puede no ser igual al precio de mercado del ETF. Los accionistas individuales pueden obtener rendimientos diferentes a la rentabilidad del NAV. La rentabilidad pasada no es un indicador ni garantía de la rentabilidad futura. Los costes reales varían en función del depositario de ejecución. Además, pueden contraerse costes de depósito, lo cual podría perjudicar a la evolución del valor. Consulte los costes pertinentes en las listas de precios correspondientes del banco depositario/liquidador. Las variaciones en los tipos de cambio podrían tener efectos positivos o negativos en esta inversión. Visite [www.libertyshares.co.uk](http://www.libertyshares.co.uk) para consultar la rentabilidad actual y lea el folleto o suplemento más recientes si quiere obtener más información. La información es histórica y puede que no refleje las características actuales o futuras de la cartera. Todas las posiciones de las carteras pueden sufrir cambios. La inversión en Franklin Templeton ICAV entraña riesgos, los cuales se describen en el folleto o suplemento más recientes y en el correspondiente KID. Franklin Templeton ICAV (domiciliada fuera de los EE. UU. o Canadá) no podrá ofrecerse ni venderse, directa o indirectamente, a residentes de los Estados Unidos de América ni de Canadá. Los ETF se negocian como las acciones, experimentan fluctuaciones en su valor de mercado y pueden cotizar a precios superiores o inferiores al valor de liquidación de los ETF. Las comisiones de corretaje y los gastos de ETF reducen la rentabilidad. Puede obtener los documentos del Fondo en inglés, alemán y francés a través de su representante local de Franklin Templeton o pueden solicitarse a través de los Servicios de Funciones para Inversores europeos del FT disponible en [www.eifs.lu/franklintempleton](http://www.eifs.lu/franklintempleton). Además, en [www.franklintempleton.lu/summary-of-investor-rights](http://www.franklintempleton.lu/summary-of-investor-rights), encontrará un resumen sobre los derechos de los inversores. Dicho resumen está disponible en inglés. Se notifica la comercialización de Franklin Templeton ICAV en múltiples Estados miembros de la UE conforme a la Directiva sobre OICVM. Franklin Templeton ICAV puede poner fin a dichas notificaciones con respecto a cualquier clase de acciones o subfondo en cualquier momento mediante el proceso contemplado en el artículo 93a de la Directiva sobre OICVM.

Para evitar dudas, si usted decide invertir, estará comprando participaciones/acciones en el Fondo y no estará invirtiendo directamente en los activos subyacentes del Fondo. Standard & Poor's® y S&P son marcas comerciales registradas de Standard & Poor's Financial Services LLC (S&P); Dow Jones es una marca comercial registrada de Dow Jones Trademark Holdings LLC (Dow Jones); S&P Dow Jones Indices LLC (SPDJ) cuenta con licencias de uso de estas marcas y Franklin Templeton, con sublicencias para usos específicos. SPDJI, Dow Jones, S&P, sus respectivas filiales y terceros licenciantes no patrocinan, respaldan, venden ni promueven los productos financieros de Franklin Templeton; ninguna de estas partes hace declaraciones acerca de la conveniencia de invertir en dicho(s) producto(s) ni tiene responsabilidad en relación con ellos, entre otras cosas, por los errores, omisiones o interrupción de ninguno de los índices. Los índices no están gestionados y no se puede invertir directamente en ellos. Tampoco reflejan las comisiones, costes o gastos de suscripción. El desempeño de los índices no incluye la deducción de los gastos ni representa el desempeño de ningún fondo de Franklin Templeton.

Los índices no están gestionados y no puede invertirse directamente en ellos. No reflejan las comisiones, costes o gastos de ventas.

La rentabilidad neta comprende los ingresos tras deducir los impuestos retenidos al pagar los dividendos.

STANDARD & POOR'S®, S&P® y S&P 500® son marcas registradas de Standard & Poor's Financial Services LLC. Standard & Poor's no patrocina, avala, vende o promociona ningún producto basado en índices S&P.

**Datos del Fondo:**

**TER:** La ratio total de gasto (TER) de un fondo representa el total de costes y gastos de un fondo como porcentaje del volumen medio del fondo en el último ejercicio económico.

**Metodología:** La metodología indica si un ETF retiene todos los valores del índice con la misma ponderación que el índice (es decir, replicación física) o si se utiliza un subconjunto optimizado de valores del índice (es decir, optimizada) para realizar un seguimiento eficaz de la rentabilidad del índice.

**Estructura del producto:** La estructura del producto indica si un ETF retiene valores físicos (es decir, física) o si realiza un seguimiento de la rentabilidad del índice por medio de derivados (swaps; es decir, sintética).

**Gestión del Fondo:** CFA® y Chartered Financial Analyst® son marcas comerciales propiedad de CFA Institute.

**Rentabilidad:** El valor liquidativo (NAV) representa el valor por acción de un ETF. El NAV por acción se obtiene dividiendo el NAV total del fondo entre el número de acciones en circulación.

**10 Principales Posiciones:** Estos valores no representan todos los valores comprados, vendidos o recomendados a los clientes, y el lector no debe presuponer que la inversión en los valores descritos fue o será rentable.

**Rentabilidad por Dividendo:** La rentabilidad por dividendo indicada aquí se refiere al rendimiento generado por los valores integrados en la cartera y no debe emplearse como una indicación de los rendimientos recibidos de esta cartera.

**Solo para clientes profesionales. No apto para la distribución a clientes minoristas.**

**Información importante (continuación)**

**Composición del fondo:**

**Desglose por capitalización bursátil:** cuando corresponda, «N/A» representa el porcentaje de las posiciones de renta variable de la cartera para las que no se disponía de información sobre la capitalización bursátil en la fecha de publicación.