

Jahresbericht und geprüfter Abschluss

Franklin Templeton
Global Funds Plc
Ein Dachfonds mit getrennter
Haftung zwischen den Teilfonds
Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024

Das Angebot der Anteile der Teilfonds FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund, FTGF Martin Currie Improving Society Fund, Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund, Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund, FTGF ClearBridge Global Growth Fund, Legg Mason ClearBridge Growth Fund, Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund, FTGF Western Asset Asian Income Fund, Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Japan Equity Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund, FTGF Western Asset Global Credit Fund, FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund, Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund, Legg Mason Martin Currie Greater China Fund, FTGF Western Asset Infrastructure Debt Fund, FTGF Western Asset Short-Dated High Yield Fund, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund, Legg Mason US Equity Fund, Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund, Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund, FTGF Western Asset China Bond Fund, Franklin Responsible Series 3 Fund, FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund, FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund, FTGF Western Asset Global Credit Fund, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund, Legg Mason QS US Large Cap Fund und Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund wurde der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht nicht gemäß § 310 KAGB (Kaptalanlagegesetzbuch) gemeldet.

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen	3
Brief an die Anteilhaber	16
Bericht des Verwaltungsrats	17
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	20
Bericht der Verwahrstelle	22
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	23
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	24
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	34
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	49
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	52
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US High Yield Fund	56
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	60
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	63
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	65
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	69
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	74
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	78
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	85
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	94
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	98
Anlagenportfolio – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	106
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	110
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	114
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	116
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	118
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	120
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	124
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	126
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	128
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	130
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Value Fund	131
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	133
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	134
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	135
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	137
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	139
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	141
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	142
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	144
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	146
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	147
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	150
Anlagenportfolio – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	152
Anlagenportfolio – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	153
Anlagenportfolio – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	154
Anlagenportfolio – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	155
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	156
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	157
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	158
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	159
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	160
Anlagenportfolio – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	161
Bilanz – Franklin Templeton Global Funds Plc	162
Gesamtergebnisrechnung – Franklin Templeton Global Funds Plc	182
Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – Franklin Templeton Global Funds Plc	192
Erläuterungen zum Abschluss – Franklin Templeton Global Funds Plc	221

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Inhaltsverzeichnis – (Fortsetzung)

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – Franklin Templeton Global Funds Plc	290
Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – Franklin Templeton Global Funds Plc	297
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	310
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	310
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	310
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	311
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	311
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US High Yield Fund	312
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	312
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	313
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	313
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	313
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	314
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	314
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	314
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	315
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	315
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	315
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	316
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	316
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	316
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	317
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	317
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	317
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	318
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	318
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	319
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	319
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	320
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	320
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	320
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	321
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Value Fund	321
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	322
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	322
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	323
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	323
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	324
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	324
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	325
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	325
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	326
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	326
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	326
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	327
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	327
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	328
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	328
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	329
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	329
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	329
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	330
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	330
Vergütungspolitik gemäß OGAW-V (ungeprüft)	332
Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung) (ungeprüft)	333
Anhang: Offenlegung von Geschäften mit verbundenen Personen (ungeprüft)	334
Anhang: Sustainability Finance Disclosure Regulation (ungeprüft)	335

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

Joseph Carrier (Vereinigte Staaten)
 Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)
 William Jackson (Großbritannien)¹
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)
 Joseph LaRocque (Vereinigte Staaten)
 Elinor Murray (Großbritannien)²
 Jaspal Sagger (Großbritannien)
 Jane Trust (USA)⁴
 Craig Tyle (USA)²

¹ Zurückgetreten am 17. Juli 2023

² Bestellt am 27. Juli 2023

³ Bestellt am 3. November 2023

⁴ Zurückgetreten am 21. Februar 2024

Geschäftssitz

Riverside Two
 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 KV60
 Irland

Secretary

Bradwell Limited (bis 1. April 2024)
 Ten Earlsfort Terrace
 Dublin 2, D02 T380
 Irland

OGS Corporate Governance Limited (ab 1. April 2024)
 30 Molesworth Street
 Dublin 2, D02 AY19
 Irland

Berichtsfondsstatus und Ausschüttungsfondsstatus (nur für britische Anteilhaber)

Britische Anteilhaber können auf der Berichtsfondsliste von HM Revenue and Customs auf der Website <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds> prüfen, welche Anteilsklassen der Gesellschaft als britische Berichtsfonds zugelassen sind und welche Anteilsklassen den Status eines britischen Berichtsfonds haben. Diese Liste wird von HM Revenue and Customs monatlich aktualisiert.

Weitere Informationen finden Sie im Nachtragsprospekt für Investoren aus dem Vereinigten Königreich, oder kontaktieren Sie Franklin Templeton International Services S.à r.l.

Schweizer Vertreter

First Independent Fund Services Ltd
 Klausstrasse 33
 CH-8008 Zürich
 Schweiz

Schweizer Zahlstelle

NPB Neue Privat Bank Ltd
 Limmatquai 1/am Bellevue
 CH-8024 Zürich
 Schweiz

Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Gründungsurkunde sowie die Jahres- und Halbjahresberichte der Gesellschaft und eine Liste der Käufe und Verkäufe der Fonds sind kostenlos bei der schweizerischen Vertretungsstelle erhältlich.

Irischer Rechtsberater

Arthur Cox LLP
 Ten Earlsfort Terrace
 Dublin 2, D02 T380
 Irland

Verwahrstelle

The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin
 Riverside Two
 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 KV60
 Irland

Hauptvertriebs- und Hauptinformationsstelle

Franklin Distributors, LLC
 One Franklin Parkway
 San Mateo, CA 94403
 USA

Weitere Vertriebs- und Informationsstellen

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxemburg
 Großherzogtum Luxemburg

Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc.
 8F, No. 87
 Abschn. 4, Zhong Xiao E. Rd., Taipeh
 Taiwan

Franklin Templeton Investments (Asia) Limited
 17/F, Chater House
 8 Connaught Road Central
 Hongkong

Templeton Asset Management Ltd.
 7 Temasek Boulevard, #38-03
 Suntec Tower One
 Singapur, 038987

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

PricewaterhouseCoopers
 Chartered Accountants & Statutory Audit Firm
 One Spencer Dock
 North Wall Quay
 Dublin 1, D01 X9R7
 Irland

Verwaltungsstelle

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

Verwalter und Promoter

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxemburg
 Großherzogtum Luxemburg

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund ^a	27. Februar 2004	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
FTGF Western Asset US Core Bond Fund*	30. August 2002	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund*	20. April 2007	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan</p>
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund*	1. Oktober 2003	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund ^{a*b}	24. Februar 2004 (Handel eingestellt am 16. Februar 2023)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund*	29. August 2002	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset US High Yield Fund*	27. Februar 2004	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund ^{^*b}	24. Februar 2004 (Handel eingestellt am 10. Oktober 2022)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^{^*b}	21. Oktober 2011 (Handel eingestellt am 21. Juni 2022)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien</p>
FTGF Western Asset Global High Yield Fund*	20. April 2007	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund ^{^*b}	20. April 2007 (Handel eingestellt am 8. November 2019)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^{^*b}	20. April 2007 (Handel eingestellt am 2. August 2019)	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^{^*b}	20. April 2007 (Handel eingestellt am 5. Dezember 2022)	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund*	12. Juni 2008	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd. 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund*	3. Juni 2009	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pte. Ltd. 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^{^*}	3. Dezember 2010	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan</p>
FTGF Western Asset Global Credit Fund ^{^*}	19. November 2010	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien</p>
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{^*P}	3. Dezember 2010 (Handel eingestellt am 21. Juni 2022)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund ^{^*}	5. September 2013	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^{^*†}	16. Dezember 2015 (Handel eingestellt am 10. Dezember 2019)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^{^*}	16. Dezember 2015	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan</p>
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^{^*†}	31. Dezember 2015 (Handel eingestellt am 13. November 2019)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^{^*}	13. Januar 2016	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund ^{^*}	13. Januar 2016	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund ^{^*p}	17. November 2016 (Handel eingestellt am 23. Oktober 2023)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund ^{^*p}	17. November 2016 (Handel eingestellt am 10. November 2023)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
FTGF Western Asset Infrastructure Debt Fund ^{^*^}		<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset Short-Dated High Yield Fund ^{**^}		<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
FTGF Western Asset Asian Income Fund ^{**}		<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund ^{^*}	11. Januar 2021	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund ^{^*b}	10. Januar 2022 (Handel eingestellt am 5. Dezember 2023)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien</p>
FTGF Western Asset China Bond Fund ^{^**^}		<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund*	1. Oktober 2003	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund ^{^*}	3. April 2012	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global High Yield Fund ^{^*}	30. November 2012	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund*	25. Juni 2010	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund ^{^*b}	10. Mai 2012 (Handel eingestellt am 25. Februar 2021)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund*	3. Juni 2013	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^{^*}	30. Juni 2014	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund ^{^*b}	6. April 2017 (Handel eingestellt am 24. März 2023)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund ^{^*b}	30. Oktober 2017 (Handel eingestellt am 29. Januar 2020)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund ^{^*}	16. August 2018 (wird am 17. Juli 2024 den Handel einstellen)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund ^{^*}	1. Dezember 2022	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund ^{^*}	6. November 2023	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^{***b}	31. Dezember 2015 (Handel eingestellt am 24. März 2023)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund ^{**^}		Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF ClearBridge Value Fund ^{**}	23. März 1998	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Growth Fund ^{***b}	25. Februar 2004 (Handel eingestellt am 15. Februar 2019)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund ^{***b}	1. September 2006 (Handel eingestellt am 22. November 2019)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund ^{**}	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund ^{**}	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund ^{**}	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund ^{**}	3. Juni 2013	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund ^{***}	30. September 2015	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Global Growth Fund ^{**^}	29. Juni 2018	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund ^{**^}	22. September 2023	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund ^{**^}	9. Dezember 2016	Anlageverwalter: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund ^{**^b}	31. März 2017 (Handel eingestellt am 17. November 2022)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund**	30. April 2021	Anlageverwalter: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund**	8. November 2002	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
FTGF Royce US Smaller Companies Fund**	1. März 2004	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^***	1. Dezember 2021	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^***^b	30. August 2002 (Handel eingestellt am 11. Juli 2022)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund**^b	25. Februar 2004 (Handel eingestellt am 17. Juli 2023)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^***^b	20. April 2007 (Handel eingestellt am 25. Februar 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^***^b	28. April 2008 (Handel eingestellt am 14. April 2021)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^***^b	29. Dezember 2010 (Handel eingestellt am 27. April 2022)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Legg Mason QS US Large Cap Fund^***		Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund**^{a^b}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 20. April 2023)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland Unteranlageverwalter: Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund**^{a^b}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 21. August 2019)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland Unteranlageverwalter: Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund**^{Ab}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 1. Juni 2021)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund**^{Ab}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 31. Juli 2017)	
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund**^{Ab}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 15. November 2019)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund**^A	28. Juni 2016	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund**	28. Juni 2016	Anlageverwalter: Franklin Templeton Australia Limited Level 47 120 Collins Street, Melbourne VIC 3000 Australien
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund**^A	24. November 2017	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund**^{1A}		Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund**^A	9. November 2018	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGF Martin Currie Improving Society Fund**^A	20. Juni 2023	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund**^{1A}		Anlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason US Equity Fund^{Ab}	8. Januar 2008 (Handel eingestellt am 24. August 2010, am 13. April 2012 neu gestartet und Handel wieder eingestellt am 30. August 2013)	
Legg Mason Japan Equity Fund^{Ab}	2. Oktober 2008 (Handel eingestellt am 30. November 2010)	
Franklin Responsible Income 2028 Fund*^A	23. Januar 2023	Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Franklin Responsible Income 2029 Fund**[†][^] (vormals Franklin Responsible Series 2 Fund, umbenannt am 21. Februar 2024)	27. März 2024	Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
Franklin Responsible Series 3 Fund**[†][^]		Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich

[†] Zum Ende des Geschäftsjahres haben diese Fonds nicht mit dem Handel begonnen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

^μ Money Market Fund.

* Rentenfonds (Fonds, die überwiegend in Rentenwerte und verzinsliche Wertpapiere investieren).

** Aktienfonds (Fonds, die überwiegend in Aktien investieren).

*** Multi-Asset Fund (jeder Fonds, der als „Multi-Asset Fund“ im jeweiligen Nachtrag des Prospekts definiert wurde).

[♯] Bis zum Widerruf der Genehmigung durch die Zentralbank.

[♦] Die Genehmigungen wurden auf Antrag der Gesellschaft am 30. April 2024 von der Zentralbank widerrufen.

Weitere Informationen

Weitere Informationen zum Fondsangebot der Franklin Templeton Global Funds Plc erhalten Sie von den folgenden Stellen:

Für professionelle Anleger in Europa (außer VK und Schweiz)

Franklin Templeton International Services S.à r.l
8A, rue Albert Borschette
L-1246 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

www.franklinresources.com

Für zugelassene Broker in Nord-, Süd- und Mittelamerika

Franklin Templeton Investments
1395 Brickell Avenue
Suite 1550
Miami, Florida 33131, USA
Tel: + 305 529 4400

www.franklintempletonoffshore.com

Auf den jeweiligen Internetseiten finden Sie Informationen über:

- Tägliche Quotierungen
- Literatur, einschließlich Datenblätter sowie die neuesten Informationen über die einzelnen Fonds
- Weitere Informationen über die Tochtergesellschaften von Franklin Templeton im Bereich Vermögensverwaltung, die die Fonds verwalten

Brief an die Anteilsinhaber

Sehr geehrte Anteilsinhaberin, sehr geehrter Anteilsinhaber,

wir freuen uns, Ihnen den Jahresbericht für Franklin Templeton Global Funds Plc (die „Gesellschaft“) für den Zwölfmonatszeitraum zum 29. Februar 2024 vorlegen zu können. In diesem Bericht heben wir die Haupttreiber der Entwicklung der Anleihe- und Aktienmärkte während des Berichtszeitraums hervor.

Bericht über die Weltwirtschaft

Trotz der anhaltenden Inflation und einiger geopolitischer Spannungen blieb die Weltwirtschaft im Berichtszeitraum widerstandsfähig. In seinem *World Economic Outlook Update* von Januar 2024 prognostizierte der Internationale Währungsfonds („IWF“) ein Wachstum des globalen Bruttoinlandsprodukts („BIP“) von 3,1 % im Jahr 2024 (keine Veränderung gegenüber 2023). Dem IWF zufolge sei angesichts der Disinflation und des stetigen Wachstums die Wahrscheinlichkeit einer harten Landung zurückgegangen und die Risiken für das globale Wachstum seien weitgehend ausgeglichen. Aus regionaler Perspektive prognostiziert der IWF, dass das BIP-Wachstum im Jahr 2024 in den USA bei 2,1 % (2023: 2,5 %), in der Eurozone bei 0,9 % (2023: 0,5 %) und in Japan bei 0,9 % (2023: 1,9 %) liegen wird.

Marktüberblick – Rentenmärkteⁱ

Der globale Rentenmarkt erfuhr Phasen der Volatilität, zog jedoch im Berichtszeitraum insgesamt an. In den USA erhöhte die Notenbank („Fed“) die Zinsen aufgrund anhaltender Inflation zunächst. Im Juli 2023 hob die Fed die Zinssätze auf 5,25–5,50 % an, den höchsten Stand seit 22 Jahren. Die Zentralbank pausierte dann bei ihren nächsten drei Sitzungen mit Zinserhöhungen und vollzog im Dezember 2023 einen „Schwenk“, indem sie das wahrscheinliche Ende der Zinsanhebungen andeutete und drei Zinssenkungen für 2024 in Aussicht stellte. Auf ihrer Sitzung im Januar 2024 hielt die US-Notenbank die Zinsen jedoch erneut konstant und sagte, sie werde in Bezug auf Zinssenkungen einen maßvollen Ansatz verfolgen. US-Staatsanleihen und Investment-Gradeⁱⁱ-Unternehmensanleihenⁱⁱⁱ verzeichneten positive Renditen. US-Unternehmensanleihen mit niedrigerem Rating und auf US-Dollar lautende Schwellenländer-Staatsanleihen erzielten im Berichtszeitraum sogar noch bessere Ergebnisse.

Marktüberblick – Globale Aktien^{iv}

Der globale Aktienmarkt erzielte im Berichtszeitraum eine starke Rendite. Die Stimmung der Anleger wurde durch das anhaltende globale Wachstum, insgesamt bessere Unternehmensgewinne, die häufig über den Erwartungen lagen, und den Kurswechsel der Fed gestützt. Diese positiven Faktoren gleichen mehrere Negativfaktoren aus, darunter eine Reihe geopolitischer Probleme. In dem Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 rentierte der S&P 500 Index mit 30,45 %. Außerhalb der USA verzeichneten internationale Industrieländeraktien, gemessen am MSCI EAFE Index (net), einen Zuwachs von 14,41 %, während Schwellenländeraktien, gemessen am Emerging Markets Index (net), mit 8,73 % rentierten.

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Mit freundlichen Grüßen

Franklin Templeton International Services S.à r.l

März 2024

Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist keine Garantie für die zukünftige Wertentwicklung. Diese Informationen sind weder als Prognose für künftige Ereignisse noch als Garantie für künftige Ergebnisse noch als Anlageberatung zu werten.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 29. Februar 2024, sofern nichts anderes angegeben ist.

Franklin Templeton Global Funds plc ist ein als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital konstituierter Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds, der in Irland von der Central Bank of Ireland als an Organismus für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren zugelassen ist.

Sämtliche Anlagen sind mit einem Risiko verbunden, einschließlich des möglichen Verlustes des Anlagekapitals. Die historische Wertentwicklung lässt keine Schlussfolgerungen auf künftige Wertentwicklungen zu und wird unter Umständen nicht wiederholt.

Die Informationen und Daten in diesem Material stammen aus Quellen, die als zuverlässig gelten, sie werden jedoch nicht durch ein Unternehmen der Franklin Resources, Inc. oder durch ein mit der Franklin Resources, Inc. verbundenes Unternehmen (zusammen „Franklin Templeton“) garantiert.

Zum Ausdruck gebrachte Meinungen können sich ohne Vorankündigung ändern und berücksichtigen nicht die spezifischen Anlageziele, finanzielle Lage oder die Bedürfnisse einzelner Anleger.

Vor der Anlage sollten Sie die wesentlichen Anlegerinformationen und den Prospekt lesen, die das vollständige Anlageziel und die Risikofaktoren des Teilfonds enthalten. Diese und sonstige relevante Unterlagen sind in einer Reihe von Sprachen von BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company, One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, Irland, www.franklinresources.com und am eingetragenen Sitz erhältlich.

Herausgegeben und genehmigt durch die Franklin Templeton International Services S.à r.l, 8A, rue Albert Borschette, L-1246 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg, mit offiziellem Sitz in Luxemburg und reguliert durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier.

Dieses Dokument ist nicht für Personen oder Verwendungszwecke bestimmt, wenn dies gegen örtliche Gesetze oder aufsichtsrechtliche Vorschriften verstößt. Franklin Templeton ist nicht verantwortlich und haftet nicht, wenn dieses Dokument weiterverteilt wird.

ⁱ Rentenwerte – Anleihen.

ⁱⁱ Investment Grade – ein Kreditrating, das bedeutet, dass eine Staats- oder Unternehmensanleihe ein relativ geringes Ausfallrisiko hat.

ⁱⁱⁱ Unternehmensanleihe – eine Anleihe, die von einem Unternehmen begeben wird, um zur Expansion seines Geschäfts effektiv Geld zu beschaffen.

^{iv} Aktien – Eigentumsbeteiligung an einer Gesellschaft in Form von Stammaktien oder Vorzugsaktien.

Bericht des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft („Verwaltungsrat“) legt seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das am 29. Februar 2024 beendete Geschäftsjahr vor.

Erklärung zu den Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Berichts des Verwaltungsrats und des Abschlusses gemäß irischem Recht verantwortlich.

Gemäß irischem Gesellschaftsrecht ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jedes Geschäftsjahr einen Abschluss zu erstellen, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der Gesellschaft zum Ende des Geschäftsjahrs und des Gewinns oder Verlustes der Gesellschaft für das Geschäftsjahr vermittelt. Der Verwaltungsrat hat den Abschluss im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen einschließlich des Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and the Republic of Ireland“ [Der in Großbritannien und in der Republik Irland geltende Standard zur Finanzberichterstattung] („FRS 102“) erstellt wurde.

Gemäß irischem Gesellschaftsrecht darf der Verwaltungsrat den Abschluss nur genehmigen, wenn er davon überzeugt ist, dass er ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der Gesellschaft zum Ende des Geschäftsjahrs und des Gewinns oder Verlustes der Gesellschaft für das Geschäftsjahr vermittelt.

Bei der Erstellung dieses Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

- geeignete Rechnungslegungsvorschriften auswählen und diese dann konsequent anwenden,
- angemessene und umsichtige Beurteilungen und Schätzungen vornehmen,
- angeben, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit den geltenden Rechnungslegungsgrundsätzen erstellt wurde, und die entsprechenden Grundsätze angeben, wobei wesentliche Abweichungen von diesen Grundsätzen offenzulegen und im Anhang zum Abschluss zu erläutern sind, und
- den Abschluss der Gesellschaft auf der Grundlage der Annahme erstellen, dass die Gesellschaft ihren Geschäftsbetrieb fortführt, es sei denn, diese Annahme ist nicht aufrechtzuerhalten.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, sicherzustellen, dass angemessene Aufzeichnungen geführt werden, die ausreichend sind, um:

- die Transaktionen der Gesellschaft korrekt aufzeichnen und erläutern,
- es jederzeit ermöglichen, die Aktiva und Passiva, die finanzielle Position sowie den Gewinn oder Verlust der Gesellschaft mit angemessener Genauigkeit zu ermitteln, und
- es dem Verwaltungsrat erlauben sicherzustellen, dass der Abschluss die Anforderungen des Companies Act von 2014 erfüllt, und eine Prüfung dieses Abschlusses ermöglichen.

Zu diesem Zweck hat der Verwaltungsrat einen erfahrenen Verwalter, BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company ernannt, um die Geschäftsbücher zu führen und weitere Verwaltungsaufgaben wahrzunehmen.

Der Verwaltungsrat ist außerdem dafür verantwortlich, das Vermögen der Gesellschaft zu schätzen. Zur Erfüllung dieser Verantwortung hat er The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin, mit der Verwahrung der Vermögenswerte der Gesellschaft gemäß der Satzung der Gesellschaft betraut. Der Verwaltungsrat ist außerdem dafür verantwortlich, angemessene Maßnahmen zur Verhinderung betrügerischer Handlungen und anderer Unregelmäßigkeiten sowie zu deren Aufdeckung zu ergreifen.

Der Verwaltungsrat ist verantwortlich für die Pflege und die Integrität der Finanzinformationen auf den Websites der mit Franklin Templeton verbundenen Unternehmen, die die Fonds vertreiben. Die für die Erstellung und Veröffentlichung von Abschlüssen geltenden Rechtsvorschriften in Irland können von den Rechtsvorschriften anderer Länder abweichen.

Überblick über die Geschäftstätigkeit und zukünftige Entwicklungen

Der Brief an die Anteilhaber auf Seite 16 beinhaltet eine Darstellung der Faktoren, die zur Performance der Fonds im Berichtsjahr beigetragen haben. Der Verwaltungsrat erwartet keine Veränderungen hinsichtlich der Anlageziele der bestehenden Fonds.

Einzelheiten zur Wertentwicklung der einzelnen Anteilklassen der aktiven Fonds finden Sie unter „Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft)“.

Die zum Ende des Geschäftsjahrs gehaltenen und erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden in den Anlagenportfolios der Fonds ausgewiesen.

Zum 29. Februar 2024 hatte die Gesellschaft 44 aktive Fonds (2023: 48 Fonds). Einzelheiten zu ihren Nettoinventarwerten zum 29. Februar 2024 sind der Bilanz auf den Seiten Seite 162 bis Seite 181 zu entnehmen.

Mit Wirkung vom 24. März 2023 haben der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 20. April 2023 hat der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 hat der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel aufgenommen.

Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 hat der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 22. September 2023 hat der FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^] den Handel aufgenommen.

Mit Wirkung vom 23. Oktober 2023 hat der FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 6. November 2023 hat der FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^] den Handel aufgenommen.

Mit Wirkung vom 10. November 2023 hat der FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 5. Dezember 2023 hat der FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

Risikomanagement – Ziele und Richtlinien

Informationen zu einigen der Ziele und Grundsätze des Risikomanagements der Gesellschaft sind in Erläuterung 12 zum Abschluss enthalten.

Ergebnisse des Geschäftsjahrs und Finanzlage zum 29. Februar 2024

Die Bilanz zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 und die Gesamtergebnisrechnung für die Geschäftsjahre zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 sind auf den Seiten Seite 162 bis Seite 181 bzw. Seite 182 bis Seite 190 dargelegt.

Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

Die Ausschüttungen an die Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen für die am 29. Februar 2024 und am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahre sind in der Gesamtergebnisrechnung dargelegt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

Bedeutende Ereignisse

Siehe Erläuterung 14 mit Einzelheiten zu bedeutenden Ereignissen während des Berichtsjahres.

Ereignisse nach dem Stichtag

Siehe Erläuterung 16 mit Einzelheiten zu Ereignissen nach Ende des Geschäftsjahres.

Mitglieder des Verwaltungsrats

Die Namen der derzeit oder zu irgendeiner Zeit im Finanzjahr amtierenden Verwaltungsratsmitglieder sind unten aufgelistet.

Joseph Carrier (Vereinigte Staaten)
 Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)
 William Jackson (Großbritannien)¹
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)
 Joseph LaRocque (Vereinigte Staaten)
 Elinor Murray (Großbritannien)³
 Jaspal Sagger (Großbritannien)
 Jane Trust (USA)⁴
 Craig Tyle (USA)²

¹ Zurückgetreten am 17. Juli 2023

² Bestellt am 27. Juli 2023

³ Bestellt am 3. November 2023

⁴ Zurückgetreten am 21. Februar 2024

Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs

Der Verwaltungsrat bzw. der Gesellschaftssekretär und deren Familien besitzen keine Beteiligungen an den Anteilen der Gesellschaft zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023. Kein Verwaltungsratsmitglied hatte zu einem jeglichen Zeitpunkt im Laufe des Geschäftsjahres eine erhebliche Beteiligung an einem wesentlichen Vertrag, der während des Jahres oder zum Geschäftsjahresende im Hinblick auf das Geschäft der Gesellschaft existierte.

Erklärung zur Corporate Governance

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft (der „Verwaltungsrat“) hat alle im freiwilligen Corporate Governance Code for Collective Investment Schemes and Management Companies von Irish Funds vom Dezember 2011 (der „Irish Funds Code“) vorgesehenen Maßnahmen geprüft. Der Verwaltungsrat hat alle Praktiken und Verfahren des Corporate Governance-Code im Irish Funds Code übernommen.

Compliance-Erklärung des Verwaltungsrats

Die Unternehmenspolitik der Gesellschaft ist darauf ausgerichtet, die einschlägigen Verpflichtungen (gemäß dem Companies Act von 2014) zu erfüllen. Gemäß Section 225(2) des Companies Act von 2014 bestätigt der Verwaltungsrat, dass er dafür verantwortlich ist, die Erfüllung der einschlägigen Verpflichtungen sicherzustellen. Der Verwaltungsrat hat eine Grundsatzerklärung zur Compliance gemäß Section 225(3)(a) des Companies Act von 2014 entwickelt, sowie eine Compliance-Richtlinie in Bezug auf die bestehenden Vorkehrungen und Strukturen, die nach Ansicht des Verwaltungsrats darauf ausgerichtet sind, die einschlägigen Verpflichtungen der Gesellschaft im Wesentlichen zu erfüllen. Bei der Erfüllung seiner Aufgaben gemäß Section 225 stützte sich der Verwaltungsrat unter anderem auf Dienstleistungen, Empfehlungen und/oder Zusicherungen Dritter, die nach Ansicht des Verwaltungsrats über die erforderlichen Kenntnisse und Erfahrungen verfügen, um die wesentliche Erfüllung der einschlägigen Verpflichtungen der Gesellschaft sicherzustellen.

Relevante Prüfungsinformationen

Soweit dem Verwaltungsrat bekannt ist, liegen keine relevanten Prüfungsinformationen vor, die den Abschlussprüfern der Gesellschaft nicht bekannt sind, und der Verwaltungsrat hat alle Schritte unternommen, die von ihm erwartet werden, um alle relevanten Prüfungsinformationen zu erlangen und sicherzustellen, dass den Abschlussprüfern der Gesellschaft diese Informationen bekannt sind.

Transaktionen mit verbundenen Personen

In Regulation 43(1) der Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „Central Bank UCITS Regulations“) heißt es, dass eine „verantwortliche Person sicherstellen muss, dass jede Transaktion zwischen einem OGAW und einer verbundenen Person (a) zu Marktbedingungen und (b) im besten Interesse der Anteilhaber des OGAW durchgeführt wird“.

Gemäß den Anforderungen von Regulation 81(4) der Central Bank UCITS Regulations hat sich der Verwaltungsrat davon überzeugt, dass (a) durch schriftliche Verfahren belegte Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die durch Regulation 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen auf alle Geschäfte mit verbundenen Personen angewendet werden und (b) alle Geschäfte mit verbundenen Personen, die während des Geschäftsjahres abgeschlossen wurden, den durch die Regulation 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen entsprachen.

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

PricewaterhouseCoopers hat seine Bereitschaft erklärt, weiterhin in Übereinstimmung mit Section 383(2) des Companies Act von 2014 im Amt zu bleiben.

Anlageziele und Anlagepolitik

Alle aktiven Fonds, außer dem FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Credit Fund[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global - US Fixed Income Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^], FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], wurden von der Securities and Futures Commission in Hongkong zugelassen. Daher sind die oben genannten Fonds nicht zum Verkauf an die Öffentlichkeit zugelassen. Die Zulassung durch die Securities and Futures Commission of Hong Kong stellt keine Empfehlung für eine Anlage in die Fonds dar.

Das Hauptanlageziel und die Anlagepolitik aller Fonds sind in dem entsprechenden Nachtrag zum Verkaufsprospekt aufgeführt. Gleichwohl kann nicht garantiert werden, dass ein Fonds sein Anlageziel erreichen oder dass eine Anlagestrategie erfolgreich sein wird oder bestimmte Ergebnisse oder ein bestimmtes Rentabilitätsniveau erreicht werden (definierte Begriffe entsprechen ihrer Definition im Verkaufsprospekt des jeweiligen Fonds (der „Verkaufsprospekt“)).

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

Regelmäßige Berichterstattung nur für Artikel-8- und Artikel-9-Produkte gemäß SFDR

Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen in regelmäßigen Berichten

Die Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) (die „SFDR“) schreibt vor, dass die Gesellschaft in ihre regelmäßigen Berichte eine Beschreibung aufnehmen muss, inwieweit jeder nach Artikel 8 SFDR (ein „Artikel-8-Fonds“) oder Artikel 9 SFDR (ein „Artikel-9-Fonds“) eingestufte Fonds seinen ökologischen oder sozialen Merkmalen gerecht wurde. Gemäß SFDR sind zudem die Europäische Bankenaufsicht, die Europäische Aufsichtsbehörde für das Versicherungswesen und die betriebliche Altersversorgung und die Europäische Wertpapieraufsichtsbehörde (zusammen die „europäischen Aufsichtsbehörden“) befugt, Entwürfe für technische Regulierungsstandards („RTS“) auszuarbeiten, die Inhalt und Format der Informationen für die regelmäßigen Berichte vorgeben. Die folgenden Angaben wurden unter Anwendung der einheitlichen Vorgaben für Nachhaltigkeitsangaben bzw. die diesbezügliche Berichterstattung gemäß den RTS gemacht. Diese Vorgaben traten am 1. Januar 2023 in Kraft.

Weitere Informationen finden Sie im Anhang zu diesem Jahresbericht – Sustainability Finance Disclosure Regulation (unaudited).

Taxonomie

Transparenz über ökologisch nachhaltige Investitionen in periodischen Berichten

Gemäß seiner ESG-Methodik kann ein Artikel-8-Fonds Investments halten, die einen Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel leisten. Aufgrund des Mangels an zuverlässigen, aktuellen und überprüfbaren Daten ist es derzeit jedoch nicht möglich zu bestimmen, inwieweit und in welchem Umfang die Aktivitäten der zugrunde liegenden Investitionen unter Wirtschaftstätigkeiten fallen, die gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen und zur Änderung der Verordnung (EU) 2019/2088 in der jeweils gültigen Fassung (die „Taxonomie-Verordnung“) als ökologisch nachhaltig angesehen werden. Daher ist es nicht möglich, dass sich ein Artikel-8-Fonds zu einem Mindestanteil an zugrunde liegenden Investitionen verpflichtet, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangsaktivitäten im Sinne der Taxonomieverordnung, berücksichtigen.

Die den Fonds, die Gegenstand dieser periodischen Berichterstattung gemäß RTS sind, zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen oder berücksichtigten (bis zu dem Zeitpunkt, zu dem sie den Handel einstellten) nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomieverordnung“). Daher kann es sein, dass der Fonds keine Anlagen hält, deren Wirtschaftstätigkeiten als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Taxonomieverordnung gelten. Gemäß seiner ESG-Methodik kann ein Artikel-8-Fonds jedoch Investments halten, die einen Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel leisten. Anleger werden darauf hingewiesen, dass der Grundsatz „Keine erhebliche Beeinträchtigung“ gemäß der Taxonomie-Verordnung nur für diejenigen einem Artikel-8-Fonds zugrunde liegenden Anlagen gilt, bei denen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigt sind. Bei den Anlagen, die dem übrigen Teil eines Artikel-8-Fonds zugrunde liegen, sind nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Taxonomie-Verordnung berücksichtigt. Die obige Erklärung gilt bzw. galt (bis zu dem Zeitpunkt, zu dem der betreffende Fonds den Handel einstellte) für die folgenden Artikel-8-Fonds: FTGF Western Asset US Core Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset Global High Yield Fund, FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028[^].

Der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] ist ein nachhaltiger Fonds gemäß den Anforderungen von Artikel 9 SFDR.

Bei den Anlagen, die den übrigen und oben nicht aufgeführten Fonds zugrunde liegen, sind oder waren (bis zu dem Zeitpunkt, zu dem sie den Handel einstellten) nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigt.

Im Namen des Verwaltungsrats

Fionnuala Doris
Verwaltungsratsmitglied

Joseph Keane
Verwaltungsratsmitglied

13. Juni 2024

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die deutsche Fassung des Prüfvermerks ist eine Übersetzung des ursprünglich in englischer Sprache verfassten Vermerks des Abschlussprüfers und dient rein der Information. Bei Abweichungen zwischen der englischen Fassung dieses Vermerks und einer Übersetzung in einer anderen Sprache ist die englische Fassung maßgeblich.

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Mitglieder der Templeton Global Funds Plc

Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

Prüfungsurteil

Wir sind zu der Auffassung gelangt, dass der Jahresabschluss der Franklin Templeton Global Funds Plc:

- ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Gesellschaft und der Teilfonds zum 29. Februar 2024 sowie der Ergebnisse für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr vermittelt,
- ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit der allgemein anerkannten Rechnungslegungspraxis in Irland (vom Financial Reporting Council des Vereinigten Königreichs herausgegebene Rechnungslegungsstandards, einschließlich Financial Reporting Standard 102 „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ und irisches Recht) erstellt wurde, und
- ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit den Anforderungen des Companies Act 2014 und der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) erstellt wurde.

Wir haben den im Jahresbericht und im geprüften Jahresabschluss enthaltenen Jahresabschluss geprüft, der Folgendes umfasst:

- die Bilanz zum 29. Februar 2024,
- die Gesamtergebnisrechnung für das an diesem Datum abgelaufene Geschäftsjahr,
- die Aufstellung über die Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr,
- das Anlagenportfolio für jeden Teilfonds zum 29. Februar 2024, und
- den Anhang zum Jahresabschluss für die Gesellschaft und jeden ihrer Teilfonds einschließlich einer Beschreibung der Rechnungslegungsgrundsätze.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung unter Beachtung der International Standards on Auditing (Irland) („ISAs (Irland)“) und des geltenden Rechts durchgeführt.

Unsere Verantwortlichkeiten gemäß den ISAs (Irland) sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses“ unseres Berichts weiter beschrieben. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Unabhängigkeit

Wir blieben von der Gesellschaft unabhängig in Übereinstimmung mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Jahresabschlusses in Irland relevant sind, wozu auch der Ethical Standard der IAASA gehört, und wir haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Zusatz – Abschluss auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt

Bei unserem Prüfungsurteil zum Jahresabschluss, das sich nicht ändert, weisen wir auf Erläuterung 2 zum Abschluss hin, in dem die Gründe genannt sind, warum der Jahresabschluss des FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund und FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt wurde.

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung

Mit Ausnahme des FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund und FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, bei denen ein anderer Grundsatz als das Fortführungsprinzip zugrunde gelegt wurde, wie oben in dem „Zusatz – Abschluss auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt“ erläutert, haben wir auf der Grundlage unserer Prüfungshandlungen keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fortführungsfähigkeit der Gesellschaft oder ihrer Teilfonds für mindestens die nächsten zwölf Monate ab dem Datum, an dem der Abschluss zur Veröffentlichung freigegeben wurde, aufwerfen könnten.

Mit Ausnahme des FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund, des FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], des FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund, des FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], des FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, des FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund und FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, bei denen ein anderer Grundsatz als das Fortführungsprinzip zugrunde gelegt wurde, wie oben in dem „Zusatz – Abschluss auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt“ erläutert, sind wir bei der Prüfung des Jahresabschlusses zu dem Schluss gelangt, dass die Anwendung des Fortführungsprinzips bei der Erstellung des Abschlusses durch den Verwaltungsrat angemessen ist.

Da jedoch nicht alle zukünftigen Ereignisse oder Bedingungen vorhergesagt werden können, ist diese Schlussfolgerung keine Garantie für die Fähigkeit der Gesellschaft und der Teilfonds zur Fortführung des Unternehmens.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten der Directors in Bezug auf die Unternehmensfortführung sind in den entsprechenden Abschnitten dieses Berichts beschrieben.

Berichterstattung über andere Informationen

Die sonstigen Informationen umfassen alle Informationen des Jahresberichts und des geprüften Jahresabschlusses, die nicht den Jahresabschluss und den Bestätigungsvermerk des Abschlussprüfers betreffen. Für die übrigen Informationen sind die Geschäftsführer verantwortlich. Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt die sonstigen Informationen nicht ab, und dementsprechend geben wir kein Prüfungsurteil oder, sofern in diesem Bericht nicht ausdrücklich anders angegeben, keine Form der Zusicherung dazu ab. In Verbindung mit unserer Prüfung des Jahresabschlusses ist es unsere Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu berücksichtigen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Jahresabschluss oder zu unserem bei der Prüfung gewonnenen Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir eine offensichtliche wesentliche Unstimmigkeit oder eine wesentliche Fehldarstellung identifizieren, sind wir verpflichtet, Verfahren durchzuführen, um festzustellen, ob eine wesentliche Fehldarstellung des Abschlusses oder eine wesentliche Fehldarstellung der anderen Informationen vorliegt. Wenn wir auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfungshandlungen zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Fehldarstellung dieser anderen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, dies zu melden. Wir haben nichts zu berichten, was auf diesen Verantwortlichkeiten beruht.

Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers – (Fortsetzung)

In Bezug auf den Directors' Report haben wir auch geprüft, ob die nach dem Companies Act 2014 erforderlichen Angaben enthalten sind.

Auf der Grundlage der oben beschriebenen Verantwortlichkeiten und unserer im Rahmen der Prüfung durchgeführten Arbeit sind wir gemäß den ISAs (Irland) und dem Companies Act 2014 verpflichtet, auch über bestimmte Bestätigungsvermerke und Sachverhalte zu berichten, wie nachstehend beschrieben:

- Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung durchgeführten Handlungen stimmen die Angaben im Bericht des Verwaltungsrats für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 mit dem Jahresabschluss überein und wurden in Übereinstimmung mit den anwendbaren gesetzlichen Vorschriften erstellt.
- Auf der Grundlage unserer Kenntnisse und unseres Verständnisses der Gesellschaft und ihres Umfelds, die wir bei der Prüfung gewonnen haben, haben wir keine wesentlichen fehlerhaften Angaben im Bericht des Verwaltungsrats festgestellt.

Verantwortlichkeiten für den Jahresabschluss und die Abschlussprüfung

Verantwortlichkeiten der Directors für den Abschluss

Wie in der Erklärung zu den Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats auf Seite 17 ausführlicher erläutert, sind die Mitglieder des Verwaltungsrats für die Erstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit dem geltenden Regelwerk verantwortlich und dafür, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt.

Die Direktoren sind auch für die internen Kontrollen verantwortlich, die sie als notwendig erachten, um die Erstellung eines Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen Fehlaussagen ist, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Fehler zurückzuführen sind.

Bei der Aufstellung des Abschlusses sind die Verwaltungsratsmitglieder dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft und der Teilfonds zur Fortführung der Geschäftstätigkeit zu beurteilen, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung der Geschäftstätigkeit - sofern zutreffend - anzugeben sowie dafür, den Rechnungslegungsgrundsatz der Fortführung der Geschäftstätigkeit anzuwenden, es sei denn, die Verwaltungsratsmitglieder beabsichtigen entweder, die Gesellschaft zu liquidieren oder den Geschäftsbetrieb einzustellen, oder haben keine realistische Alternative dazu, dies zu tun.

Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist, und einen Bestätigungsvermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit den ISAs (Irland) durchgeführte Prüfung immer eine wesentliche falsche Darstellung aufdeckt, wenn diese vorhanden ist. Falsche Darstellungen können aus Betrug oder Irrtum resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen der Leserschaft beeinflussen.

Unsere Prüfung könnte die Prüfung kompletter Populationen bestimmter Transaktionen und Salden beinhalten, möglicherweise unter Verwendung von Datenprüfungstechniken. Dabei wird jedoch typischerweise eine begrenzte Anzahl von Items zum Testen ausgewählt, anstatt komplette Populationen zu testen. Wir werden oft versuchen, bestimmte Posten aufgrund ihres Umfangs oder ihrer Risikomerkmale gezielt zu testen. In anderen Fällen verwenden wir Stichproben, um eine Aussage über die Grundgesamtheit treffen zu können, aus der die Stichprobe ausgewählt wird.

Eine weitere Beschreibung unserer Verantwortlichkeiten für die Abschlussprüfung finden Sie auf der Website der IAASA unter:

https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Diese Beschreibung ist Teil unseres Bestätigungsvermerks.

Verwendung dieses Berichts

Dieser Bericht, einschließlich des Bestätigungsvermerks, wurde ausschließlich für die Mitglieder der Gesellschaft als Gremium in Übereinstimmung mit Abschnitt 391 des Companies Act 2014 und für keinen anderen Zweck erstellt. Mit der Abgabe dieser Stellungnahmen übernehmen wir keine Verantwortung für einen anderen Zweck oder gegenüber einer anderen Person, der dieser Bericht gezeigt wird oder in deren Hände er gelangt, es sei denn, wir haben dem vorher ausdrücklich schriftlich zugestimmt.

Andere erforderliche Berichte

Companies Act 2014 Stellungnahmen zu anderen Angelegenheiten

- Wir haben alle Informationen und Erklärungen erhalten, die wir für die Zwecke unserer Prüfung für erforderlich halten.
- Unserer Meinung nach waren die Buchhaltungsunterlagen der Gesellschaft ausreichend, um eine einfache und ordnungsgemäße Prüfung des Jahresabschlusses zu ermöglichen.
- Der Jahresabschluss stimmt mit den Buchhaltungsunterlagen überein.

Companies Act 2014 Ausnahmeberichterstattung

Vergütungen und Transaktionen der Directors

Gemäß dem Companies Act 2014 sind wir verpflichtet, Ihnen Bericht zu erstatten, wenn unserer Meinung nach die in den Abschnitten 305 bis 312 dieses Gesetzes vorgeschriebenen Angaben zu den Vergütungen und Transaktionen der Direktoren nicht gemacht wurden. Wir haben keine Ausnahmen zu berichten, die sich aus dieser Verantwortung ergeben.

Andrew O'Callaghan
für und im Namen von PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants and Statutory Audit Firm
Dublin

17. Juni 2024

Bericht der Verwahrstelle

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilssinhaber 13. Juni 2024

Für den Berichtszeitraum vom 1. März 2023 bis 29. Februar 2024 (der „Berichtszeitraum“)

Die Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch (die „**Verwahrstelle**“, „**uns**“, „**wir**“, „**unser**“ usw.), hat in ihrer Eigenschaft als Verwahrstelle der Gesellschaft das Verhalten von Franklin Templeton Global Funds plc (die „Gesellschaft“) im Berichtszeitraum untersucht.

Dieser Bericht einschließlich des Bestätigungsvermerks wurde für und ausschließlich für die Anteilssinhaber der Gesellschaft in Übereinstimmung mit unserer Rolle als Verwahrstelle der Gesellschaft und für keinen anderen Zweck erstellt. Mit der Abgabe dieses Bestätigungsvermerks übernehmen wir keine Verantwortung für einen anderen Zweck oder gegenüber einer anderen Person, der dieser Bericht gezeigt wird.

Verantwortlichkeiten der Verwahrstelle

Unsere Pflichten und Verantwortlichkeiten sind in Regulation 34 der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (S.I. No 352 of 2011) in ihrer geänderten Fassung (die „Regulations“) dargelegt.

Unser Bericht legt dar, ob die Gesellschaft in diesem Zeitraum unserer Auffassung nach unter Einhaltung der Bestimmungen der Gründungsdokumente sowie der Regulations geleitet wurde. Es liegt in der Gesamtverantwortung der Gesellschaft, diese Bestimmungen zu erfüllen. Falls die Gesellschaft nicht entsprechend geführt wurde, sind wir als Verwahrstelle verpflichtet anzugeben, in welcher Hinsicht sie nicht entsprechend geführt wurde und welche Schritte wir diesbezüglich unternommen haben.

Grundlage des Bestätigungsvermerks der Verwahrstelle

Die Verwahrstelle führt solche Überprüfungen durch, die sie nach ihrem vernünftigen Ermessen für erforderlich hält, um ihren Pflichten nachzukommen und um sicherzustellen, dass die Gesellschaft in allen wesentlichen Belangen (i) in Übereinstimmung mit den Beschränkungen ihrer Anlage- und Kreditaufnahmebefugnisse durch die Bestimmungen ihrer Gründungsunterlagen und der entsprechenden Vorschriften und (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit den Gründungsunterlagen der Gesellschaft und den entsprechenden Vorschriften geführt wurde.

Bestätigungsvermerk

Unserer Auffassung nach ist die Gesellschaft in diesem Berichtszeitraum in allen wesentlichen Aspekten unter Einhaltung folgender Vorschriften geführt worden:

- (i) in Übereinstimmung mit den Beschränkungen der Anlage- und Kreditaufnahmebefugnisse der Gesellschaft durch die Gründungsunterlagen und die Vorschriften und
- (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit den Gründungsunterlagen und den Vorschriften.

Für und im Namen von The Bank of New York Mellon SA/NV,
Dublin Branch,
Riverside Two,
Sir John Rogerson's Quay Dublin 2,
D02 KV60,
Irland

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 73,28 % (28. Februar 2023: 71,90 %)					
USA – 73,28 % (28. Februar 2023: 71,90 %)					
13.625	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,350 %, fällig am 18.03.2024 *	1,22	22.600	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 04.02.2024	2,02
25.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 5,350 %, fällig am 29.04.2024 *	2,24	25.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 04.04.2024	2,23
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 5,390 %, fällig am 06.05.2024 *	0,90	26.100	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 16.04.2024	2,33
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 5,390 %, fällig am 24.05.2024 *	0,90	10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 18.04.2024	0,89
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,390 %, fällig am 04.06.2024 *	0,90	15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 23.04.2024	1,33
1.600	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,475 %, fällig am 27.06.2024 *	0,14	15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 25.04.2024	1,33
1.600	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,490 %, fällig am 16.10.2024 *	0,14	20.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 30.04.2024	1,78
5.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,340 %, fällig am 27.11.2024 *	0,45	10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 05.02.2024	0,89
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,495 %, fällig am 10.02.2025 *	0,90	15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 05.09.2024	1,33
5.000	Federal Farm Credit Discount Notes, Nullkupon, fällig am 22.08.2024	0,44	10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 16.05.2024	0,89
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 20.03.2024	0,89	15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 23.05.2024	1,33
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 22.04.2024	0,89	20.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 30.05.2024	1,77
5.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 31.10.2024	0,43	8.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 27.06.2024	0,70
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0001, 5,360 %, fällig am 14.03.2024 *	0,90	10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 07.05.2024	0,88
20.000	Federal Home Loan Banks, 5,430 %, fällig am 14.03.2024 *	1,79	5.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 07.11.2024	0,44
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0003, 5,360 %, fällig am 25.03.2024 *	0,90	10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 15.08.2024	0,87
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 5,355 %, fällig am 26.03.2024 *	0,90	10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 22.08.2024	0,87
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0002, 5,360 %, fällig am 28.03.2024 *	0,90	5.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 29.08.2024	0,44
4.000	Federal Home Loan Banks, 5,370 %, fällig am 03.05.2024 *	0,36	10.000	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 31.07.2024	0,89
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0002, 5,310 %, fällig am 10.05.2024 *	0,90	15.000	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.08.2024	1,33
15.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 5,375 %, fällig am 10.05.2024 *	1,35			
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 5,375 %, fällig am 24.05.2024 *	0,90	816.638		73,28
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,375 %, fällig am 24.05.2024 *	0,90	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 816.638 \$)		
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0001, 5,430 %, fällig am 28.05.2024 *	0,90	Umgekehrte Pensionsgeschäfte – 27,78 % (28. Februar 2023: 29,37 %)		
15.000	Federal Home Loan Banks, 5,310 %, fällig am 30.05.2024 *	1,35	USA – 27,78 % (28. Februar 2023: 29,37 %)		
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,450 %, fällig am 11.06.2024	0,90	70.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 70.010.286 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 71.410.554 USD), 5,290 %, fällig 01.03.2024	6,28
15.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 5,370 %, fällig am 18.06.2024 *	1,35	55.000	HSBC Bank USA, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 55.008.021 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 56.108.186 USD), 5,250 %, fällig 01.03.2024	4,94
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0002, 5,310 %, fällig am 05.07.2024 *	0,90	95.000	JP Morgan Securities LLC, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 95.013.986 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 96.914.341 USD), 5,300 %, fällig 01.03.2024	8,52
15.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 5,310 %, fällig am 09.07.2024 *	1,35	50.000	Royal Bank of Canada, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 50.007.306 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 51.000.043 USD), 5,260 %, fällig 01.03.2024	4,49
15.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 5,315 %, fällig am 08.08.2024 *	1,35	39.597	TD Securities (USA) LLC, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 39.602.830 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 40.388.940 USD), 5,300 %, fällig 01.03.2024	3,55
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0001, 5,315 %, fällig am 13.08.2024 *	0,90			
5.000	Federal Home Loan Banks, 1,610 %, fällig am 04.09.2024	0,44	309.597		27,78
10.000	Federal Home Loan Banks, 2,875 %, fällig am 13.09.2024	0,88	Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte (Anschaffungskosten 309.597 \$)		
1.195	Federal Home Loan Banks, 5,425 %, fällig am 06.11.2024 *	0,11	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
5.000	Federal Home Loan Banks, 5,620 %, fällig am 12.11.2024	0,45	1.126.235		101,06
5.300	Federal Home Loan Banks, 5,500 %, fällig am 22.11.2024 *	0,47	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,430 %, fällig am 21.02.2025 *	0,90	1.126.235		101,06
5.000	Federal National Mortgage Association, 1,625 %, fällig am 07.01.2025	0,44	-11.817		-1,06
21.700	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 03.05.2024	1,94	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
25.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 03.07.2024	2,24	Gesamtvermögen		
26.500	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 03.12.2024	2,37	1.114.418	\$	100,00
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 14.03.2024	0,89	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
23.500	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 19.03.2024	2,10	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.		
20.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 21.03.2024	1,79	Verteilung des Gesamtvermögens		
20.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 26.03.2024	1,79	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
20.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 28.03.2024	1,79	Geldmarktinstrumente		
			Sonstige Vermögenswerte		
			Gesamtvermögen		
			100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 8,75 % (28. Februar 2023: 9,59 %)					
300	37 Capital CLO II, Series 2022 1A, Class A1A, 144A, 7,314 %, fällig am 15.07.2034 *	0,16	333	Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class AA, 144A, 2,301 %, fällig am 28.02.2033	0,17
600	AB BSL CLO 4 Ltd, Series 2023 4A, Class A, 144A, 7,318 %, fällig am 20.04.2036 *	0,33	500	Symphony CLO 40 Ltd, Series 2023 40A, Class A1, 144A, 6,984 %, fällig am 14.01.2034 *	0,27
1.000	Apidos CLO XXXVII, Series 2021 37A, Class A, 144A, 6,709 %, fällig am 22.10.2034 *	0,54	490	Trinitas CLO XVI Ltd, Series 2021 16A, Class A1, 144A, 6,759 %, fällig am 20.07.2034 *	0,26
260	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2023 1A, Class A2, 144A, 7,824 %, fällig am 05.03.2053	0,15	460	Trinitas CLO XXV Ltd, Series 2023 25A, Class A1, 144A, 7,181 %, fällig am 23.01.2037 *	0,25
415	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2003-W7, Series 2003 W3, Class M1, 3,853 %, fällig am 25.09.2033 *	0,20	632	Voya CLO 2016-3 Ltd, Series 2016 3A, Class A1R, 144A, 6,750 %, fällig am 18.10.2031 *	0,34
315	Barings Private Credit Corp CLO 2023-1 Ltd, Series 2023 1A, Class A1, 144A, 7,714 %, fällig am 15.07.2031 *	0,17	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 16,223 \$)		8,75
390	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, Series 2015 8A, Class A1AR, 144A, 6,679 %, fällig am 20.01.2031 *	0,21	Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 42,48 % (28. Februar 2023: 36,20 %)		
140	Birch Grove CLO 6 Ltd, Series 2023 6A, Class A1, 144A, 7,518 %, fällig am 20.07.2035 *	0,08	510	AREIT 2022-CRE7 LLC, Series 2022 CRE7, Class A, 144A, 7,562 %, fällig am 17.06.2039 *	0,28
450	Birch Grove CLO 8 Ltd, Series 2024 8A, Class A1, 144A, 0,000 %, fällig am 20.04.2037 *	0,24	210	BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Class A5, 3,688 %, fällig am 15.02.2061	0,11
643	Brazos Higher Education Authority Inc, Series 2011 2, Class A3, 6,623 %, fällig am 27.10.2036 *	0,35	130	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Class A5, 3,666 %, fällig am 15.01.2051 *	0,07
210	Brightwood Capital MM CLO 2023-1 Ltd, Series 2023 1A, Class A1A, 144A, 8,111 %, fällig am 15.10.2035 *	0,12	10.069	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, Series 2018 B5, Class XA, 0,460 %, fällig am 15.07.2051 *	0,09
630	Canyon CLO 2020-1 Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144A, 6,756 %, fällig am 15.07.2034 *	0,34	879	BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class A, 144A, 6,865 %, fällig am 15.07.2035 *	0,47
270	Cayuga Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144A, 6,698 %, fällig am 17.07.2034 *	0,15	450	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Series 2024 NQM2, Class A1, 144A, 6,285 %, fällig am 25.02.2064	0,24
312	CBAM 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class A1, 144A, 6,829 %, fällig am 20.07.2030 *	0,17	100	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Series 2017 CD3, Class A4, 3,631 %, fällig am 10.02.2050	0,05
66	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2001 HE22, Class A1, 5,759 %, fällig am 25.02.2032 *	0,03	130	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Series 2014 GC23, Class B, 4,175 %, fällig am 10.07.2047 *	0,07
30	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, Series 2007 13, Class 2A2, 6,235 %, fällig am 25.10.2047 *	0,01	3.754	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Series 2016 C3, Class XA, 0,982 %, fällig am 15.11.2049 *	0,04
132	CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, Series 2004 5, Class 2A, 5,935 %, fällig am 25.10.2034 *	0,07	186	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-C4, Series 2017 C4, Class A3, 3,209 %, fällig am 12.10.2050	0,09
24	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-F, Series 2006 F, Class 2A1A, 5,572 %, fällig am 15.07.2036 *	0,01	23	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust, Series 2015 LC19, Class ASB, 3,040 %, fällig am 10.02.2048	0,01
134	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Class 2A, 5,572 %, fällig am 15.01.2037 *	0,07	200	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Series 2015 PC1, Class A5, 3,902 %, fällig am 10.07.2050	0,11
420	Golub Capital Partners CLO 57M Ltd, Series 2021 57A, Class A1, 144A, 7,076 %, fällig am 25.10.2034 *	0,23	340	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M2, 144A, 8,422 %, fällig am 25.03.2042 *	0,19
150	Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, Series 2023 66A, Class A, 144A, 7,275 %, fällig am 25.04.2036 *	0,08	430	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, Series 2023 R06, Class 1M2, 144A, 8,022 %, fällig am 25.07.2043 *	0,24
381	Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Series 2023 3C, Class A, 144A, 6,500 %, fällig am 20.07.2055	0,21	250	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1M2, 144A, 7,122 %, fällig am 25.01.2044 *	0,14
252	Greywolf CLO V Ltd, Series 2015 1A, Class A1R, 144A, 6,746 %, fällig am 27.01.2031 *	0,14	100	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1, Class AS, 3,791 %, fällig am 15.04.2050 *	0,05
480	Jack in the Box Funding LLC, Series 2022 1A, Class A2I, 144A, 3,445 %, fällig am 26.02.2052	0,24	338	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class A2, 144A, 3,500 %, fällig am 25.02.2048 *	0,16
308	Loampal Solar Loan 2021-1 Ltd, Series 2021 1GS, Class A, 144A, 2,290 %, fällig am 20.01.2048	0,13	955	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class B2, 144A, 3,583 %, fällig am 25.02.2048 *	0,45
536	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class M1, 6,185 %, fällig am 25.02.2034 *	0,28	126	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C03, Class 1M2, 8,436 %, fällig am 25.07.2024 *	0,07
209	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, Series 2004 4, Class M1, 6,335 %, fällig am 25.10.2034 *	0,11	1	Fannie Mae Interest Strip 390, Class C3, 6,000 %, fällig am 25.07.2038	–
407	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2004-WMC5, Series 2004 WMC5, Class M1, 6,365 %, fällig am 25.07.2035 *	0,22	3	Fannie Mae Interest Strip 407, Class 41, 6,000 %, fällig am 25.01.2038	–
325	MKS CLO 2017-2 Ltd, Series 2017 2A, Class A, 144A, 6,769 %, fällig am 20.01.2031 *	0,18	7	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig am 25.11.2041	–
386	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8, Series 2004 NC8, Class M1, 6,350 %, fällig am 25.09.2034 *	0,20	7	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C18, 4,000 %, fällig am 25.04.2042	–
25	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-NC2, Series 2005 NC2, Class M4, 6,350 %, fällig am 25.03.2035 *	0,01	4	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C2, 3,000 %, fällig am 25.04.2027	–
348	Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, Series 2021 3A, Class B, 144A, 1,920 %, fällig am 20.06.2052	0,14	300	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	0,15
313	Navient Student Loan Trust 2017-3, Series 2017 3A, Class A3, 144A, 6,486 %, fällig am 26.07.2066 *	0,17	800	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	0,41
603	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, Series 2018 29A, Class A1, 144A, 6,701 %, fällig am 19.10.2031 *	0,32	600	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	0,31
83	NovaStar Mortgage Funding Trust Series 2003-3, Series 2003 3, Class A1, 6,145 %, fällig am 25.12.2033 *	0,04	31	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig am 01.10.2044	0,02
730	Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class AR, 144A, 6,796 %, fällig am 15.10.2034 *	0,39	20	Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000 %, fällig am 06.01.2043	0,01
240	Ocean Trails Clo XI, Series 2021 11A, Class A, 144A, 6,799 %, fällig am 20.07.2034 *	0,13	189	Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000 %, fällig am 02.01.2041	0,10
500	Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class A1, 144A, 7,318 %, fällig am 20.01.2035 *	0,27	8	Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig am 05.01.2040	–
490	Palmer Square CLO 2022-5 Ltd, Series 2022 5A, Class A, 144A, 7,318 %, fällig am 20.10.2035 *	0,27	63	Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, fällig am 10.01.2046	0,03
57	SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 10B, Class 1, 3,548 %, fällig am 10.09.2028	0,03	46	Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig am 11.01.2046	0,02
65	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Class A4A, 5,886 %, fällig am 16.12.2041 *	0,03	36	Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, fällig am 12.01.2046	0,01
296	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Series 2010 C, Class A5, 144A, 10,182 %, fällig am 15.10.2041 *	0,17	20	Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, fällig am 04.01.2025	0,02
128	SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Series 2020 A, Class A2A, 144A, 2,230 %, fällig am 15.09.2037	0,07	43	Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000 %, fällig am 06.01.2042	0,02
			21	Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig am 09.01.2042	0,01
			17	Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, fällig am 06.01.2043	0,01
			39	Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig am 07.01.2043	0,02
			206	Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,500 %, fällig am 06.01.2046	188
			87	Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, fällig am 08.01.2046	75
			55	Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, fällig am 09.01.2046	0,04
			20	Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, fällig am 02.01.2037	18
			37	Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, fällig am 02.01.2047	32
			41	Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000 %, fällig am 05.01.2047	0,02
			15	Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000 %, fällig am 06.01.2043	15
			24	Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, fällig am 10.01.2043	0,01
			39	Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, fällig am 05.01.2046	34
			62	Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, fällig am 08.01.2046	0,03
			87	Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, fällig am 09.01.2046	0,04
			35	Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, fällig am 01.01.2047	0,02
			37	Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, fällig am 10.01.2046	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
357			230		
Government National Mortgage Association, Series 2020 181, Class VI, 2,000 %, fällig am 20.12.2050	40	0,02	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, fällig am 13.04.2028	223	0,12
1.636			60		
Government National Mortgage Association, Series 2020 195, Class IO, 0,926 %, fällig am 16.12.2062 *	105	0,06	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig am 01.06.2030	55	0,03
239			300		
Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050	43	0,02	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig am 01.06.2040	269	0,14
136			100		
Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050	25	0,01	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig am 06.10.2048	88	0,05
159			30		
Government National Mortgage Association, Series 2020 H04, Class FP, 5,963 %, fällig am 20.06.2069 *	158	0,09	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig am 23.01.2049	31	0,02
182				698	0,38
Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class FL, 6,613 %, fällig am 20.05.2070 *	181	0,10	Brasilien – 0,86 % (28. Februar 2023: 0,57 %)		
100			10		
Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class NF, 6,713 %, fällig am 20.04.2070 *	101	0,05	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig am 17.03.2024	10	0,01
62			47		
Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FA, 5,913 %, fällig am 20.07.2070 *	60	0,03	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig am 05.06.2115	57	0,02
5.842			1.100		
Government National Mortgage Association, Series 2021 10, Class IO, 0,986 %, fällig am 16.05.2063 *	392	0,21	Suzano Austria GmbH, 6,000 %, fällig am 15.01.2029	1.100	0,59
151			21		
Government National Mortgage Association, Series 2021 115, Class MI, 2,500 %, fällig am 20.05.2051	16	0,01	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig am 21.11.2036	21	0,01
417			390		
Government National Mortgage Association, Series 2021 188, Class PA, 2,000 %, fällig am 20.10.2051	342	0,18	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig am 10.11.2039	418	0,23
167				1.596	0,86
Government National Mortgage Association, Series 2021 2, Class AH, 1,500 %, fällig am 16.06.2063	126	0,07	Kanada – 0,47 % (28. Februar 2023: 0,83 %)		
83			130		
Government National Mortgage Association, Series 2021 223, Class P, 2,000 %, fällig am 20.06.2051	72	0,04	Bank of Montreal, 1,850 %, fällig am 01.05.2025	125	0,07
4.935			30		
Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,112 %, fällig am 16.01.2061 *	381	0,21	Bank of Montreal, 3,803 %, fällig am 15.12.2032 *	28	0,02
200			80		
Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class B, 1,850 %, fällig am 16.02.2061	100	0,05	Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, fällig am 11.04.2025	78	0,04
865			240		
Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig am 16.02.2061 *	42	0,02	Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig am 11.06.2025	228	0,12
100			70		
Government National Mortgage Association, Series 2022 63, Class LM, 3,500 %, fällig am 20.10.2050	83	0,04	Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig am 04.05.2037 *	63	0,03
300			80		
Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class AH, 2,000 %, fällig am 16.06.2064	231	0,12	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig am 30.05.2041	81	0,04
570			40		
GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Series 2018 3PCK, Class B, 144A, 8,182 %, fällig am 15.09.2031 *	562	0,30	Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig am 15.10.2039	41	0,02
68			60		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, Series 2005 9, Class 2A1B, 6,174 %, fällig am 20.06.2035 *	62	0,03	Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig am 10.06.2025	57	0,03
450			110		
Independence Plaza Trust 2018-INDP, Series 2018 INDP, Class A, 144A, 3,763 %, fällig am 10.07.2035	430	0,23	Royal Bank of Canada, 3,875 %, fällig am 04.05.2032	100	0,06
120			80		
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class AS, 4,202 %, fällig am 15.09.2047 *	118	0,06	Royal Bank of Canada, 5,150 %, fällig am 01.02.2034	79	0,04
419				880	0,47
Mill City Mortgage Trust 2015-2, Series 2015 2, Class M3, 144A, 3,705 %, fällig am 25.09.2057 *	410	0,22	China – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,45 %)		
100			120		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, Series 2014 C18, Class AS, 4,110 %, fällig am 15.10.2047 *	98	0,05	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig am 01.05.2025	116	0,06
258			670		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30, Series 2016 C30, Class A4, 2,600 %, fällig am 15.09.2049	244	0,13	Prosus NV, 144A, 4,027 %, fällig am 03.08.2050	427	0,23
217				543	0,29
Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Series 2017 ASHF, Class A, 144A, 6,465 %, fällig am 15.11.2034 *	215	0,12	Kolumbien – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,33 %)		
550			650		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class A, 144A, 3,047 %, fällig am 15.08.2036	502	0,27	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig am 28.05.2045	482	0,26
145			Frankreich – 0,54 % (28. Februar 2023: 0,73 %)		
New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, Series 2015 2A, Class A1, 144A, 3,750 %, fällig am 25.08.2055 *	135	0,07	400		
222			BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig am 09.06.2026 *	383	0,21
New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250 %, fällig am 25.09.2056 *	202	0,11	410		
223			BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig am 13.01.2029 *	407	0,22
New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2, Series 2017 2A, Class B1, 144A, 4,500 %, fällig am 25.03.2057 *	209	0,11	200		
244			BNP Paribas SA, 144A, 5,894 %, fällig am 05.12.2034 *	205	0,11
New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig am 25.05.2058 *	235	0,13		995	0,54
149			Indien – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,14 %)		
New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3, 144A, 1,353 %, fällig am 25.10.2058 *	135	0,07	270		
364			Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig am 12.01.2052	197	0,10
OBX 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A1, 144A, 5,928 %, fällig am 25.11.2063	364	0,20	Irland – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,29 %)		
4			230		
Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, Series 2007 4, Class 1A1, 3,912 %, fällig am 25.09.2037 *	4	–	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29.10.2026	212	0,11
300			360		
UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Series 2018 C15, Class C, 5,140 %, fällig am 15.12.2051 *	267	0,14	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29.10.2028	324	0,18
289				536	0,29
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class A3, 2,807 %, fällig am 15.11.2059	271	0,15	Japan – 0,21 % (28. Februar 2023: 0,15 %)		
150			400		
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class A4, 3,065 %, fällig am 15.11.2059	140	0,08	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, fällig am 17.04.2026 *	392	0,21
1.366			Kasachstan – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,44 %)		
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class XA, 1,165 %, fällig am 15.11.2059 *	31	0,02	560		
460			KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig am 24.04.2030	544	0,29
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, Series 2017 C41, Class B, 4,188 %, fällig am 15.11.2050 *	409	0,22	Macau – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,15 %)		
1.480			200		
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class XA, 0,543 %, fällig am 15.10.2057 *	1	–	Sands China Ltd, 5,125 %, fällig am 08.08.2025	197	0,11
	78.783	42,48	Mexiko – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,62 %)		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 82.359 \$)			400		
			Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,875 %, fällig am 26.07.2033	328	0,18
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 33,45 % (28. Februar 2023: 37,25 %)			450		
Australien – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,05 %)			Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875 %, fällig am 11.05.2031	365	0,19
70			590		
BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig am 30.09.2043	67	0,04	Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig am 08.11.2042	555	0,30
				1.248	0,67
Belgien – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,45 %)			Niederlande – 0,66 % (28. Februar 2023: 0,65 %)		
33			500		
Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, fällig am 01.02.2026	32	0,02	Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig am 04.08.2025	490	0,26
			260		
			Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, fällig am 21.05.2025	255	0,14
			180		
			Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig am 06.04.2030	160	0,09
			10		
			Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig am 12.08.2043	9	–
			260		
			Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig am 10.05.2046	214	0,12
			130		
			Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig am 06.04.2050	93	0,05
				1.221	0,66
			Peru – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,33 %)		
			400		
			Petroleos del Peru SA, 4,750 %, fällig am 19.06.2032	314	0,17
			200		
			Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig am 19.06.2047	137	0,07
				451	0,24

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
10 Comcast Corp, 3,250 %, fällig am 01.11.2039	8	–	90 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig am 16.11.2026	86	0,05
40 Comcast Corp, 3,750 %, fällig am 01.04.2040	33	0,02	40 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig am 15.03.2028 *	38	0,02
20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig am 15.08.2047	16	0,01	130 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig am 23.04.2029 *	123	0,07
20 Comcast Corp, 3,969 %, fällig am 01.11.2047	16	0,01	660 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig am 01.05.2029 *	633	0,34
20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig am 01.03.2048	16	0,01	30 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig am 01.02.2041	32	0,02
10 Comcast Corp, 3,999 %, fällig am 01.11.2049	8	–	260 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig am 22.05.2045	248	0,13
90 Comcast Corp, 2,800 %, fällig am 15.01.2051	56	0,03	10 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig am 21.10.2045	9	–
291 Comcast Corp, 2,887 %, fällig am 01.11.2051	184	0,10	50 Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100 %, fällig am 23.06.2025	47	0,03
54 Comcast Corp, 2,937 %, fällig am 01.11.2056	33	0,02	30 Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig am 15.04.2027	28	0,01
10 Comcast Corp, 4,950 %, fällig am 15.10.2058	9	–	80 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig am 15.04.2030	71	0,04
20 ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig am 15.04.2029	22	0,01	80 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig am 15.04.2032	53	0,03
90 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig am 01.04.2030	82	0,04	240 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig am 15.04.2040	188	0,10
30 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig am 01.04.2050	24	0,01	20 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig am 15.06.2047	16	0,01
110 Constellation Brands Inc, 4,350 %, fällig am 09.05.2027	108	0,06	60 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig am 15.04.2050	43	0,02
170 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig am 15.01.2028	164	0,09	20 Humana Inc, 4,500 %, fällig am 01.04.2025	20	0,01
210 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig am 15.01.2031	206	0,11	110 Humana Inc, 3,950 %, fällig am 15.03.2027	106	0,06
140 Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig am 20.04.2032	112	0,06	150 Humana Inc, 3,700 %, fällig am 23.03.2029	140	0,08
170 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig am 15.05.2027	164	0,09	30 Humana Inc, 2,150 %, fällig am 03.02.2032	24	0,01
600 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig am 15.03.2029	578	0,31	50 Intel Corp, 5,125 %, fällig am 10.02.2030	50	0,03
40 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig am 01.04.2027	38	0,02	30 Intel Corp, 5,200 %, fällig am 10.02.2033	30	0,02
70 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig am 25.03.2028	68	0,04	180 Intel Corp, 4,750 %, fällig am 25.03.2050	161	0,09
220 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig am 01.04.2030	203	0,11	20 Intel Corp, 3,050 %, fällig am 12.08.2051	13	0,01
20 CVS Health Corp, 1,875 %, fällig am 28.02.2031	16	0,01	420 Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 1,750 %, fällig am 15.09.2030	343	0,19
90 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig am 15.09.2031	73	0,04	520 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig am 22.04.2026 *	500	0,27
380 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig am 25.03.2038	346	0,19	70 JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig am 15.12.2026	68	0,04
40 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig am 01.04.2040	33	0,02	100 JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig am 01.10.2027	98	0,05
40 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig am 20.07.2045	36	0,02	130 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig am 23.07.2029 *	125	0,07
220 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig am 25.03.2048	196	0,11	110 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig am 05.12.2029 *	106	0,06
3 CVS Pass-Through Trust, 5,880 %, fällig am 10.01.2028	3	–	210 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig am 22.04.2031 *	180	0,10
50 Deere & Co, 3,750 %, fällig am 15.04.2050	41	0,02	280 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig am 22.04.2032 *	234	0,13
264 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig am 20.10.2025	261	0,14	65 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig am 01.06.2045	61	0,03
190 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	186	0,10	50 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig am 22.04.2051 *	34	0,02
160 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig am 15.12.2025	161	0,09	80 Kenvue Inc, 4,900 %, fällig am 22.03.2033	79	0,04
18 Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig am 15.10.2027	18	0,01	30 Kimberly-Clark Corp, 3,100 %, fällig am 26.03.2030	27	0,01
30 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig am 15.01.2030	29	0,02	100 KLA Corp, 4,650 %, fällig am 15.07.2032	98	0,05
40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig am 15.07.2041	38	0,02	340 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	336	0,18
70 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig am 15.05.2042	59	0,03	20 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig am 25.06.2025	19	0,01
300 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig am 15.06.2045	260	0,14	90 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, fällig am 15.09.2028	61	0,03
260 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig am 01.12.2029	239	0,13	90 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig am 15.04.2030	88	0,05
30 Diamondback Energy Inc, 3,125 %, fällig am 24.03.2031	26	0,01	340 Mars Inc, 144A, 3,200 %, fällig am 01.04.2030	309	0,17
70 Eaton Corp, 4,150 %, fällig am 02.11.2042	61	0,03	250 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig am 26.03.2050	207	0,11
60 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig am 15.05.2032	55	0,03	50 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig am 01.07.2027	48	0,03
160 Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig am 09.02.2034	158	0,09	30 McDonald's Corp, 3,800 %, fällig am 01.04.2028	29	0,02
20 Eli Lilly & Co, 5,000 %, fällig am 09.02.2054	20	0,01	60 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig am 01.03.2030	51	0,03
140 Eli Lilly & Co, 5,100 %, fällig am 09.02.2064	138	0,07	80 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig am 01.07.2030	74	0,04
340 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig am 16.10.2028	328	0,18	220 McDonald's Corp, 4,875 %, fällig am 09.12.2045	203	0,11
160 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig am 31.01.2030	142	0,08	20 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig am 01.09.2049	15	0,01
350 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig am 31.01.2034	341	0,18	60 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig am 01.04.2050	50	0,03
20 Enterprise Products Operating LLC, 7,550 %, fällig am 15.04.2038	24	0,01	15 Medtronic Inc, 4,625 %, fällig am 15.03.2045	14	0,01
60 Enterprise Products Operating LLC, 5,700 %, fällig am 15.02.2042	61	0,03	130 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig am 24.06.2030	106	0,06
20 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig am 15.03.2044	18	0,01	305 MetLife Inc, 6,400 %, fällig am 15.12.2036	310	0,17
20 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig am 31.01.2051	15	0,01	80 Micron Technology Inc, 5,300 %, fällig am 15.01.2031	79	0,04
10 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig am 31.01.2060	8	–	50 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig am 09.02.2033	51	0,03
30 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig am 15.02.2078 *	28	0,01	150 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig am 17.03.2052	104	0,06
130 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig am 15.04.2030	126	0,07	20 Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A, 4,100 %, fällig am 15.05.2028	19	0,01
350 EOG Resources Inc, 3,900 %, fällig am 01.04.2035	315	0,17	130 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig am 04.05.2025	124	0,07
170 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig am 15.04.2050	159	0,09	440 Morgan Stanley, Series I, 0,864 %, fällig am 21.10.2025 *	426	0,23
140 EQT Corp, 7,000 %, fällig am 01.02.2030	148	0,08	110 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig am 28.04.2026 *	106	0,06
50 FirstEnergy Corp, Series A, 1,600 %, fällig am 15.01.2026	46	0,02	160 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig am 24.01.2029 *	151	0,08
180 FirstEnergy Corp, Series B, 4,150 %, fällig am 15.07.2027	171	0,09	210 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig am 22.01.2031 *	182	0,10
200 FirstEnergy Corp, Series C, 5,100 %, fällig am 15.07.2047	173	0,09	570 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig am 01.04.2031 *	518	0,28
120 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	120	0,06	110 MPLX LP, 4,000 %, fällig am 15.03.2028	106	0,06
60 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig am 14.11.2034	58	0,03	100 MPLX LP, 4,500 %, fällig am 15.04.2038	87	0,05
30 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig am 15.03.2043	28	0,01	40 MPLX LP, 5,200 %, fällig am 01.03.2047	36	0,02
90 General Motors Co, 5,600 %, fällig am 15.10.2032	90	0,05	60 MPLX LP, 5,200 %, fällig am 01.12.2047	54	0,03
10 General Motors Co, 6,600 %, fällig am 01.04.2036	11	0,01	50 MPLX LP, 4,700 %, fällig am 15.04.2048	42	0,02
10 General Motors Co, 5,150 %, fällig am 01.04.2038	9	–	140 New York Life Global Funding, 144A, 0,950 %, fällig am 24.06.2025	133	0,07
30 General Motors Co, 6,250 %, fällig am 02.10.2043	30	0,02	140 NIKE Inc, 2,850 %, fällig am 27.03.2030	126	0,07
10 General Motors Co, 5,950 %, fällig am 01.04.2049	10	0,01	60 NIKE Inc, 3,250 %, fällig am 27.03.2040	48	0,03
3 Goldman Sachs Capital II, 6,370 %, Ewige Anleihe *	3	–	80 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig am 01.04.2060	63	0,03
150 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig am 01.04.2025	147	0,08	50 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig am 01.11.2026	50	0,03
70 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig am 21.10.2025	69	0,04	60 ONEOK Inc, 5,800 %, fällig am 01.11.2030	61	0,03
800 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig am 12.02.2026 *	764	0,41	110 ONEOK Inc, 6,050 %, fällig am 01.09.2033	113	0,06
			180 ONEOK Inc, 6,625 %, fällig am 01.09.2053	194	0,10
			210 Oracle Corp, 1,650 %, fällig am 25.03.2026	195	0,11
			50 Oracle Corp, 4,650 %, fällig am 06.05.2030	49	0,03
			260 Oracle Corp, 2,875 %, fällig am 25.03.2031	224	0,12
			60 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, fällig am 05.04.2025	58	0,03
			50 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig am 01.08.2027	45	0,02
			150 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig am 01.02.2031	123	0,07
			20 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig am 01.08.2040	14	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig am 01.08.2050	20	0,01	200 Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, fällig am 15.03.2032	177	0,10
60 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, fällig am 01.06.2032	58	0,03	20 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, fällig am 15.03.2042	17	0,01
40 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig am 01.05.2030	33	0,02	100 Waste Connections Inc, 5,000 %, fällig am 01.03.2034	98	0,05
250 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig am 01.04.2030	221	0,12	90 Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig am 30.04.2026 *	86	0,05
90 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig am 28.05.2030	75	0,04	50 Wells Fargo & Co, 4,100 %, fällig am 03.06.2026	49	0,03
230 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig am 28.05.2040	162	0,09	30 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig am 23.10.2026	28	0,02
110 Pfizer Inc, 2,700 %, fällig am 28.05.2050	73	0,04	430 Wells Fargo & Co, 4,300 %, fällig am 22.07.2027	418	0,22
30 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, fällig am 15.01.2026	28	0,01	60 Wells Fargo & Co, 2,393 %, fällig am 02.06.2028 *	55	0,03
100 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig am 15.08.2030	83	0,04	10 Wells Fargo & Co, 4,150 %, fällig am 24.01.2029	10	–
230 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig am 15.01.2031	193	0,10	100 Wells Fargo & Co, 5,574 %, fällig am 25.07.2029 *	101	0,05
40 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, fällig am 12.06.2026 *	40	0,02	130 Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig am 30.10.2030 *	114	0,06
160 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig am 12.06.2029 *	161	0,09	120 Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig am 04.04.2031 *	114	0,06
70 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig am 23.06.2025	66	0,04	220 Wells Fargo & Co, 3,350 %, fällig am 02.03.2033 *	189	0,10
90 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig am 25.03.2030	82	0,04	20 Wells Fargo & Co, 4,650 %, fällig am 04.11.2044	17	0,01
460 Prologis LP, 1,250 %, fällig am 15.10.2030	365	0,20	50 Wells Fargo & Co, 4,900 %, fällig am 17.11.2045	44	0,02
130 Salesforce Inc, 3,700 %, fällig am 11.04.2028	125	0,07	400 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig am 14.06.2046	330	0,18
130 Solventum Corp, 144A, 5,400 %, fällig am 01.03.2029	130	0,07	190 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig am 07.12.2046	164	0,09
130 Solventum Corp, 144A, 5,450 %, fällig am 13.03.2031	129	0,07	940 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig am 04.04.2051 *	870	0,47
140 Solventum Corp, 144A, 5,600 %, fällig am 23.03.2034	139	0,07	280 Williams Cos Inc/The, 5,150 %, fällig am 15.03.2034	274	0,15
130 Solventum Corp, 144A, 5,900 %, fällig am 30.04.2054	127	0,07	30 Wyeth LLC, 5,950 %, fällig am 01.04.2037	32	0,02
140 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig am 01.03.2032	159	0,09		45.360	24,46
30 Targa Resources Corp, 4,950 %, fällig am 15.04.2052	26	0,01	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 66.913 \$)		
2 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig am 16.12.2039	2	–	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 16,36 % (28. Februar 2023: 21,89 %)		
230 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig am 01.03.2030	200	0,11	Chile – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,12 %)		
240 Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig am 04.09.2029	212	0,11	250 Internationale Staatsanleihe Chile, 3,100 %, fällig am 22.01.2061	157	0,08
70 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig am 04.05.2030	59	0,03	Kolumbien – 0,37 % (28. Februar 2023: 0,48 %)		
70 Texas Instruments Inc, 4,150 %, fällig am 15.05.2048	59	0,03	220 Internationale Staatsanleihe Kolumbien, 3,125 %, fällig am 15.04.2031	174	0,09
170 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig am 22.08.2050	107	0,06	260 Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 3,250 %, fällig 22.04.2032	201	0,11
30 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, fällig am 01.05.2037	28	0,02	400 Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 5,625 %, fällig 26.02.2044	314	0,17
100 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig am 15.11.2040	86	0,05		689	0,37
100 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig am 15.04.2025	98	0,05	Indien – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,14 %)		
20 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig am 15.04.2027	19	0,01	430 Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig am 05.08.2026	411	0,22
380 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig am 15.04.2030	353	0,19	Israel – 0,37 % (28. Februar 2023: 0,54 %)		
80 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig am 15.02.2031	67	0,04	800 Internationale Staatsanleihe Israel, 2,750 %, fällig am 03.07.2030	685	0,37
80 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig am 15.11.2031	65	0,03	Kasachstan – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,14 %)		
70 T-Mobile USA Inc, 5,150 %, fällig am 15.04.2034	69	0,04	200 Internationale Staatsanleihe Kasachstan, 4,875 %, fällig am 14.10.2044	188	0,10
110 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig am 15.02.2041	80	0,04	Mexiko – 0,88 % (28. Februar 2023: 0,83 %)		
30 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig am 15.02.2051	21	0,01	1.580 Internationale Staatsanleihe Mexiko, 4,750 %, fällig am 08.03.2044	1.305	0,71
320 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig am 01.02.2026	333	0,18	420 Internationale Staatsanleihe Mexiko, 4,400 %, fällig am 12.02.2052	317	0,17
110 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250 %, fällig am 15.05.2030	99	0,05		1.622	0,88
190 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, fällig am 15.05.2050	148	0,08	Peru – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,13 %)		
100 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig am 08.06.2027 *	101	0,05	40 Internationale Staatsanleihe Peru, 3,550 %, fällig am 10.03.2051	29	0,01
130 Union Pacific Corp, 2,400 %, fällig am 05.02.2030	113	0,06	640 Internationale Staatsanleihe Peru, 3,600 %, fällig am 15.01.2072	420	0,23
230 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig am 05.02.2070	168	0,09		449	0,24
30 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	29	0,02	Südkorea – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,20 %)		
40 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, fällig am 15.05.2029	39	0,02	510 Korea Housing Finance Corp, 144A, 4,625 %, fällig am 24.02.2033	493	0,27
100 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig am 15.05.2030	84	0,05	USA – 13,69 % (28. Februar 2023: 18,58 %)		
20 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, fällig am 15.05.2031	17	0,01	620 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 05.09.2024	614	0,33
50 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig am 15.05.2032	47	0,03	1.000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig am 15.01.2033 β	964	0,52
270 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig am 15.05.2040	195	0,10	20 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 30.04.2024	20	0,01
50 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig am 15.03.2043	44	0,02	70 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.08.2028	70	0,04
40 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig am 15.06.2048	34	0,02	20 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 30.11.2028	20	0,01
20 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig am 15.12.2048	18	0,01	40 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 30.04.2030	38	0,02
50 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig am 15.08.2049	38	0,02	2.670 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.01.2031	2.627	1,42
60 UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, fällig am 15.05.2050	40	0,02	1.230 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 28.02.2031	1.229	0,66
60 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig am 15.08.2059	46	0,02	170 United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 15.05.2042	143	0,08
20 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig am 15.05.2060	13	0,01	380 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.02.2043	348	0,19
10 US Bancorp, Series mtn, 2,215 %, fällig am 27.01.2028 *	9	–	1.990 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig am 15.05.2043	1.820	0,98
100 US Bancorp, 5,775 %, fällig am 12.06.2029 *	101	0,05	1.220 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig am 15.08.2043	1.195	0,65
90 US Bancorp, 5,836 %, fällig am 12.06.2034 *	91	0,05	700 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2043	721	0,39
300 USAA Capital Corp, 144A, 2,125 %, fällig am 01.05.2030	249	0,13	30 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2044	26	0,01
40 Verizon Communications Inc, 2,625 %, fällig am 15.08.2026	38	0,02			
40 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig am 16.03.2027	39	0,02			
100 Verizon Communications Inc, 2,100 %, fällig am 22.03.2028	89	0,05			
225 Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig am 21.09.2028	218	0,12			
100 Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig am 08.02.2029	95	0,05			
100 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig am 22.03.2030	89	0,05			
296 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig am 21.03.2031	250	0,13			
310 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig am 10.08.2033	293	0,16			
60 Verizon Communications Inc, 4,400 %, fällig am 01.11.2034	56	0,03			
20 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig am 16.03.2037	20	0,01			
210 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig am 20.11.2040	145	0,08			
30 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig am 22.03.2041	23	0,01			
10 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig am 21.08.2046	9	–			
80 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig am 22.03.2050	63	0,03			
70 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig am 23.02.2054	69	0,04			
50 Visa Inc, 4,300 %, fällig am 14.12.2045	63	0,03			
50 Visa Inc, 3,650 %, fällig am 15.09.2047	40	0,02			
30 Walmart Inc, 1,800 %, fällig am 22.09.2031	25	0,01			
20 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig am 15.11.2037	23	0,01			
60 Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, fällig am 15.03.2026	60	0,03			
30 Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, fällig am 15.03.2027	28	0,02			
60 Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, fällig am 15.03.2029	56	0,03			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
640	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.02.2048	498	0,27		
460	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.02.2049	357	0,19		
130	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig am 15.05.2049	98	0,05		
3.200	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig am 15.02.2050	1.993	1,08		
50	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig am 15.08.2050	26	0,01		
700	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig am 15.11.2050	393	0,21		
230	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.02.2052	151	0,08		
1.590	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig am 15.05.2052	1.198	0,65		
3.130	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.08.2052	2.420	1,31		
60	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig am 15.11.2052	56	0,03		
1.675	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.02.2053	1.465	0,79		
5.810	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	5.085	2,74		
990	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 15.08.2053	948	0,51		
390	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig am 15.11.2053	415	0,22		
450	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig am 15.02.2054	442	0,24		
		25.380	13,69		
Uruguay – 0,14 % (28. Februar 2023: 0,53 %)					
220	Internationale Staatsanleihe Uruguay, 7,625 %, fällig am 21.03.2036	265	0,14		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 34.322 \$)					
		30.339	16,36		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,68 % (28. Februar 2023: 1,32 %)					
3.108	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Klasse WA (ausschüttend)	3.108	1,68		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.108 \$)					
		3.108	1,68		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 202.925 \$)					
		190.499	102,72		
Kontrakte (in Tsd.)					
Gekaufte Optionen – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,05 %)					
	– CME 3 Month SOFR Futures April 2024 Put 9,75, fällig am 12.04.2024 – Goldman Sachs	3	–		
	– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Put 96,00, fällig am 13.12.2024 – Goldman Sachs	81	0,05		
	– CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 94,6250, fällig am 15.03.2024 – Goldman Sachs	3	–		
	– CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Put 94,50, fällig am 15.03.2024 – Goldman Sachs	1	–		
	– U.S. 10 Year April 2024 Put 109,75, fällig am 22.03.2024 – Goldman Sachs	5	–		
	– U.S. 10 Year May 2024 Call 111,00, fällig am 26.04.2024 – Goldman Sachs	5	0,01		
	– U.S. 2 Year Juni 2024 Call 103,50, fällig am 24.05.2024 – Goldman Sachs	2	–		
	– U.S. 5 Year April 2024 Call 108,00, fällig am 22.03.2024 – Goldman Sachs	2	–		
	– U.S. 5 Year W1 März 2024 Put 106,50, fällig am 01.03.2024 – Goldman Sachs	–	–		
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 107 \$)					
		102	0,06		
Credit Default Swaps – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,23 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	462	0,25		
Index-Swaps – 0,48 % (28. Februar 2023: 1,66 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	884	0,48		
Futures – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,23 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	156	0,08		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
		192.103	103,59		
Verkaufte Optionen – -0,04 % (28. Februar 2023: -0,05 %)					
	– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Call 97,1250, fällig am 13.12.2024 – Goldman Sachs	-10	0		
	– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Put 95,50, fällig am 13.12.2024 – Goldman Sachs	-44	0		
	– CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 95,25, fällig am 15.03.2024 – Goldman Sachs	–	–		
	– CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 96,1250, fällig am 15.03.2024 – Goldman Sachs	–	–		
	– U.S. 10 Year April 2024 Put 108,75, fällig am 22.03.2024 – Goldman Sachs	-3	–		
	– U.S. 10 Year May 2024 Put 108,00, fällig am 26.04.2024 – Goldman Sachs	-5	–		
	– U.S. 2 Year Juni 2024 Call 104,50, fällig am 24.05.2024 – Goldman Sachs	-1	–		
	– U.S. 5 Year April 2024 Put 105,25, fällig am 22.03.2024 – Goldman Sachs	-2	–		
	– U.S. Bond April 2024 Call 122,00, fällig am 22.03.2024 – Goldman Sachs	-5	–		
	– U.S. Bond Juni 2024 Call 130,00, fällig am 24.05.2024 – Goldman Sachs	–	–		
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -98 \$)					
		-70	-0,04		
Index-Swaps – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1	–		
Futures – -0,04 % (28. Februar 2023: 0,14 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-75	-0,04		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
		-886	-0,48		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
		191.217	103,11		
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten					
		-5.757	-3,11		
Gesamnettovermögen					
		185.460 \$	100,00		
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A	Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 29.434.000 USD und machten 15,88 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.				
†	Nicht liquide.				
∞	Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.				
±	Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.				
β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.				
ABKÜRZUNGEN:					
EWIGE ANLEIHE	– Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.				
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit				
TBA	– To be announced.				
Verteilung des Gesamtvermögens					
	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			94,50	
	Organismen für gemeinsame Anlagen			1,57	
	Finanzderivate			0,81	
	Sonstige Vermögenswerte			3,12	
Gesamtvermögen					
				100,00	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – -0,40 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
(900)	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	-740	-0,40		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten -739 \$)					
		-740	-0,40		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten -739 \$)					
		-740	-0,40		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	21.340	\$ 437
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2033	4.870	25
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 304 \$)				\$ 462
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -44 \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 260 \$)				\$ 462

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Zahlt festen Zinssatz von 2,600 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	954	\$ 173
Goldman Sachs	Zahlt festen Zinssatz von 3,050 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	2.107	235
Goldman Sachs	Zahlt festen Zinssatz von 3,150 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Mai 2048	2.725	261
Goldman Sachs	Zahlt festen Zinssatz von 3,530 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	31. Okt. 2030	3.588	83
Goldman Sachs	Zahlt festen Zinssatz von 3,540 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	31. Okt. 2030	5.844	132
Goldman Sachs	Zahlt festen Zinssatz von 3,870 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	28. Feb. 2031	998	-1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.192 \$)				\$ 884
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2 \$)				-1
Nettowertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.190 \$)				\$ 883

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Goldman Sachs	-32	\$ -7.572	\$ -3
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Goldman Sachs	49	11.699	-23
3 Month SOFR Index Dezember 2025	Goldman Sachs	123	29.608	38
3 Month SOFR Index März 2024	Goldman Sachs	-15	-3.551	-4
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Goldman Sachs	188	20.762	46
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Goldman Sachs	-21	-2.397	-9
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2024	Goldman Sachs	68	13.923	-7
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Goldman Sachs	48	5.131	7
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Goldman Sachs	-59	-7.036	-29
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Goldman Sachs	63	8.056	65
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 303 \$)				\$ 156
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -180 \$)				-75
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 123 \$)				\$ 81

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 6,14 % (28. Februar 2023: 6,51 %)					
1.700	37 Capital CLO II, Series 2022 1A, Class A1A, 144A, 7,314 %, fällig am 15.07.2034 *	1.709	0,21	11.999	BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class XA, 0,714 %, fällig am 15.09.2060 *
2.000	AB BSL CLO 4 Ltd, Series 2023 4A, Class A, 144A, 7,318 %, fällig am 20.04.2036 *	2.020	0,25	1.500	BANK 2018-BNK15, Series 2018 BN15, Class B, 4,661 %, fällig am 15.11.2061 *
107	Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Series 2003-3, Series 2003 3, Class M2, 7,910 %, fällig am 25.01.2034 *	99	0,01	2.570	BBCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class E, 144A, 4,563 %, fällig am 10.08.2033 *
2.745	Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Cfs Ser 2005-R8, Series 2005 R8, Class M4, 6,305 %, fällig am 25.10.2035 *	2.657	0,33	240	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 1A1, 5,595 %, fällig am 25.01.2037 *
1.000	Apidos CLO XXXVII, Series 2021 37A, Class A, 144A, 6,709 %, fällig am 22.10.2034 *	1.001	0,12	560	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Class A5, 3,666 %, fällig am 15.01.2051 *
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Series 1996 1, Class B1, 7,875 %, fällig am 10.10.2026	47	0,01	430	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Series 2017 CD3, Class A4, 3,631 %, fällig am 10.02.2050
1.500	BCRED MML CLO 2021-1 LLC, Series 2021 1A, Class A, 144A, 7,056 %, fällig am 15.01.2035 *	1.504	0,19	49	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 1A2, 6,015 %, fällig am 25.04.2035 *
1.000	BCRED MML CLO 2022-1 LLC, Series 2022 1A, Class A1, 144A, 6,968 %, fällig am 20.04.2035 *	996	0,12	300	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, Series 2015 GC27, Class AS, 3,571 %, fällig am 10.02.2048
1.740	Cayuga Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144A, 6,698 %, fällig am 17.07.2034 *	1.744	0,21	530	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1, Series 2016 C1, Class A4, 3,209 %, fällig am 10.05.2049
2.617	Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2004 3, Class 1A, 5,855 %, fällig am 25.08.2034 *	2.505	0,31	71.889	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Series 2016 C3, Class XA, 0,982 %, fällig am 15.11.2049 *
841	DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig am 20.11.2051	704	0,09	8.968	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 2A4, 5,875 %, fällig am 25.09.2036 *
2.537	Educational Funding Co LLC/The, Series 2006 1A, Class A3, 144A, 5,936 %, fällig am 25.04.2033 *	1.549	0,19	90	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class B, 4,035 %, fällig am 10.02.2048 *
2.672	Encore Credit Receivables Trust 2005-3, Series 2005 3, Class M5, 6,395 %, fällig am 25.10.2035 *	2.501	0,31	1.450	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Series 2015 PC1, Class A5, 3,902 %, fällig am 10.07.2050
4.291	Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 2005-2, Series 2005 2, Class M3, 6,215 %, fällig am 25.12.2035 *	3.737	0,46	1.620	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Series 2023 R05, Class 1M2, 144A, 8,421 %, fällig am 25.06.2043 *
182	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, Series 2017 SR01, Class A3, 3,089 %, fällig am 25.11.2027	171	0,02	560	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, Series 2023 R06, Class 1M2, 144A, 8,022 %, fällig am 25.07.2043 *
3.083	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Series 2021 1G5, Class A, 144A, 2,290 %, fällig am 20.01.2048	2.472	0,30	500	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1, Class AS, 3,791 %, fällig am 15.04.2050 *
1.150	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class M1, 6,185 %, fällig am 25.02.2034 *	1.125	0,14	1.050	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class A2, 144A, 3,953 %, fällig am 15.09.2037
1.987	Magnetite XIV-R Ltd, Series 2015 14RA, Class A2, 144A, 6,680 %, fällig am 18.10.2031 *	1.990	0,24	140	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class E, 144A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037
1.738	Magnolia Finance, 8,552 %, fällig am 09.08.2024	1.735	0,21	5.170	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037
3.134	Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, Series 2021 3A, Class B, 144A, 1,920 %, fällig am 20.06.2052	2.352	0,29	1.960	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class M2, 144A, 2,969 %, fällig am 25.07.2057 *
3.000	National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15, Class AR15, 0,000 %, fällig am 01.06.2045	274	0,03	2.230	CSMC 2021-NQMB, Series 2021 NQMB, Class A1, 144A, 1,841 %, fällig am 25.10.2066 *
3.300	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Series 2006 3, Class B, 5,795 %, fällig am 26.01.2032 *	2.746	0,34	600	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class G, 144A, 10,794 %, fällig am 15.07.2032 *
2.000	Neuberger Berman Loan Advisers Clo 42 Ltd, Series 2021 42A, Class A, 144A, 6,676 %, fällig am 16.07.2035 *	2.001	0,25	1.680	DBC 2017-BBG Mortgage Trust, Series 2017 BBG, Class A, 144A, 8,500 %, fällig am 15.06.2034 *
635	Ocean Trails Clo XI, Series 2021 11A, Class A, 144A, 6,799 %, fällig am 20.07.2034 *	637	0,08	145	Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1, Series 2006 PR1, Class 3AF1, 144A, 5,712 %, fällig am 15.04.2036 *
2.650	Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class A1, 144A, 7,318 %, fällig am 20.01.2035 *	2.670	0,33	301	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C03, Class 1M2, 8,436 %, fällig am 25.07.2024 *
1.086	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Class 1A1, 5,866 %, fällig am 25.01.2037	883	0,11	2.554	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 9,186 %, fällig am 25.10.2030 *
213	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, Series 2006 A, Class A2, 7,064 %, fällig am 15.10.2037 *	195	0,02	178	Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, Series 2017 T1, Class A, 2,898 %, fällig am 25.06.2027
1.806	Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class AV3, 6,375 %, fällig am 25.05.2034 *	1.608	0,20	10	Fannie Mae Interest Strip 390, Class C3, 6,000 %, fällig am 25.07.2038
2.344	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Series 2010 C, Class A5, 144A, 10,182 %, fällig am 15.10.2041 *	2.521	0,31	5	Fannie Mae Interest Strip 407, Class 22, 5,000 %, fällig am 25.01.2039
2	SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Series 2015 A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig am 15.10.2048	455	0,05	3	Fannie Mae Interest Strip 407, Class 23, 5,000 %, fällig am 25.01.2039 *
303	SMB Private Education Loan Trust, Series 2020 B, Class A1A, 144A, 1,290 %, fällig am 15.07.2053	276	0,03	5	Fannie Mae Interest Strip 407, Class 34, 5,000 %, fällig am 25.01.2038
1.573	Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class A, 144A, 2,675 %, fällig am 28.02.2033	1.433	0,17	14	Fannie Mae Interest Strip 407, Class 41, 6,000 %, fällig am 25.01.2038
1.002	Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1, Series 2005 HE1, Class M2, 6,155 %, fällig am 25.07.2035 *	930	0,11	45	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig am 25.11.2041
800	Trinitas CLO XXV Ltd, Series 2023 25A, Class A1, 144A, 7,181 %, fällig am 23.01.2037 *	807	0,10	52	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C18, 4,000 %, fällig am 25.04.2042
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 54.809 \$)					
		50.054	6,14		
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 43,18 % (28. Februar 2023: 32,48 %)					
1.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class A, 144A, 6,502 %, fällig am 15.09.2034 *	979	0,12	615	Fannie Mae Interest Strip 427, Class C73, 3,000 %, fällig am 25.12.2048
52	Alternative Loan Trust 2005-14, Series 2005 14, Class 2A2, 5,935 %, fällig am 25.05.2035 *	38	-	4.400	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±
185	Alternative Loan Trust 2005-56, Series 2005 56, Class 4A1, 6,055 %, fällig am 25.11.2035 *	162	0,02	2.000	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,000 % ±
37	Alternative Loan Trust 2006-18CB, Series 2006 18CB, Class A6, 6,858 %, fällig am 25.07.2036 *	32	-	200	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,500 % ±
3.660	AREIT 2022-CRE7 LLC, Series 2022 CRE7, Class A, 144A, 7,562 %, fällig am 17.06.2039 *	3.669	0,45	6	Fannie Mae Pool '745000', 6,000 %, fällig am 01.10.2035
991	BAMILL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Series 2016 GG10, Class AJA, 144A, 5,630 %, fällig am 10.08.2045 *	213	0,03	4	Fannie Mae Pool '843997', 6,871 %, fällig am 01.11.2035 *
1.956	Banc of America Funding 2014-R2 Trust, Series 2014 R2, Class 2A2, 144A, 5,649 %, fällig am 26.05.2037 *	1.693	0,21	4	Fannie Mae Pool '865915', 7,122 %, fällig am 01.03.2036 *
930	BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class A5, 3,435 %, fällig am 15.09.2060	876	0,11	327	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig am 01.10.2044
				109	Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, fällig am 01.12.2037
				13	Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, fällig am 01.08.2038
				31	Fannie Mae Pool 'AB9683', 4,000 %, fällig am 06.01.2043
				27	Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000 %, fällig am 02.01.2039

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
			87 Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, fällig am 02.01.2052	69	0,01
			87 Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, fällig am 02.01.2052	73	0,01
			261 Freddie Mac Pool 'QD8675', 2,500 %, fällig am 03.01.2052	218	0,03
			530 Freddie Mac Pool 'QE0399', 3,000 %, fällig am 04.01.2052	454	0,06
			280 Freddie Mac Pool 'QF3213', 4,500 %, fällig am 11.01.2052	265	0,03
			279 Freddie Mac Pool 'QF5465', 5,000 %, fällig am 12.01.2052	271	0,03
			91 Freddie Mac Pool 'QG2834', 5,000 %, fällig am 04.01.2053	88	0,01
			196 Freddie Mac Pool 'QG7311', 5,500 %, fällig am 07.01.2053	196	0,02
			72 Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500 %, fällig am 04.01.2041	62	0,01
			428 Freddie Mac Pool 'QK1354', 2,000 %, fällig am 02.01.2042	357	0,04
			95 Freddie Mac Pool 'QU7914', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	76	0,01
			680 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, fällig am 11.01.2050	546	0,07
			1.884 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	1.582	0,19
			488 Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, fällig am 12.01.2050	410	0,05
			572 Freddie Mac Pool 'RA4537', 1,500 %, fällig am 02.01.2051	429	0,05
			1.230 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	984	0,12
			2.778 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig am 05.01.2051	2.218	0,27
			412 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, fällig am 06.01.2051	329	0,04
			171 Freddie Mac Pool 'RA6332', 2,000 %, fällig am 11.01.2051	136	0,02
			494 Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, fällig am 01.01.2052	414	0,05
			7.144 Freddie Mac Pool 'RA6694', 2,000 %, fällig am 01.01.2052	5.633	0,69
			945 Freddie Mac Pool 'RA7186', 4,000 %, fällig am 04.01.2052	878	0,11
			816 Freddie Mac Pool 'RA7928', 4,500 %, fällig am 09.01.2052	774	0,10
			759 Freddie Mac Pool 'RA8694', 5,000 %, fällig am 04.01.2053	744	0,09
			875 Freddie Mac Pool 'RA8790', 5,000 %, fällig am 04.01.2053	851	0,10
			189 Freddie Mac Pool 'RA9079', 6,500 %, fällig am 05.01.2053	195	0,02
			184 Freddie Mac Pool 'RA9080', 6,500 %, fällig am 05.01.2053	190	0,02
			377 Freddie Mac Pool 'RA9081', 6,500 %, fällig am 05.01.2053	388	0,05
			291 Freddie Mac Pool 'RA9437', 5,500 %, fällig am 07.01.2053	288	0,04
			60 Freddie Mac Pool 'RB5071', 2,000 %, fällig am 09.01.2040	50	0,01
			1.590 Freddie Mac Pool 'RB5084', 1,500 %, fällig am 11.01.2040	1.279	0,16
			2.324 Freddie Mac Pool 'RB5110', 1,500 %, fällig am 05.01.2041	1.867	0,23
			1.718 Freddie Mac Pool 'RB5117', 1,500 %, fällig am 07.01.2041	1.378	0,17
			1.864 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig am 09.01.2041	1.558	0,19
			810 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig am 10.01.2041	714	0,09
			247 Freddie Mac Pool 'RB5131', 2,000 %, fällig am 10.01.2041	206	0,03
			119 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig am 11.01.2041	95	0,01
			252 Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000 %, fällig am 12.01.2041	210	0,03
			171 Freddie Mac Pool 'RB5141', 2,000 %, fällig am 01.01.2042	143	0,02
			517 Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, fällig am 02.01.2042	431	0,05
			258 Freddie Mac Pool 'RB5149', 2,500 %, fällig am 03.01.2042	223	0,03
			351 Freddie Mac Pool 'RB5153', 2,000 %, fällig am 04.01.2042	293	0,04
			964 Freddie Mac Pool 'SC0093', 2,000 %, fällig am 10.01.2040	811	0,10
			927 Freddie Mac Pool 'SC0160', 2,000 %, fällig am 07.01.2041	778	0,10
			320 Freddie Mac Pool 'SC0188', 2,000 %, fällig am 09.01.2041	268	0,03
			568 Freddie Mac Pool 'SC0206', 2,000 %, fällig am 11.01.2041	477	0,06
			86 Freddie Mac Pool 'SC0269', 2,000 %, fällig am 01.01.2042	72	0,01
			90 Freddie Mac Pool 'SC0310', 2,000 %, fällig am 08.01.2042	76	0,01
			271 Freddie Mac Pool 'SC0313', 2,000 %, fällig am 01.01.2042	226	0,03
			93 Freddie Mac Pool 'SC0345', 2,000 %, fällig am 05.01.2042	77	0,01
			1.224 Freddie Mac Pool 'SC0384', 2,000 %, fällig am 04.01.2042	1.026	0,13
			1.364 Freddie Mac Pool 'SC0447', 2,000 %, fällig am 05.01.2042	1.138	0,14
			293 Freddie Mac Pool 'SC0448', 2,000 %, fällig am 08.01.2042	244	0,03
			52 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, fällig am 07.01.2047	49	0,01
			202 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig am 04.01.2051	164	0,02
			413 Freddie Mac Pool 'SD0615', 4,500 %, fällig am 01.01.2051	398	0,05
			240 Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, fällig am 02.01.2051	208	0,03
			424 Freddie Mac Pool 'SD0745', 2,000 %, fällig am 11.01.2051	339	0,04
			335 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig am 01.01.2052	280	0,03
			78 Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, fällig am 09.01.2050	75	0,01
			1.557 Freddie Mac Pool 'SD1305', 5,000 %, fällig am 07.01.2052	1.513	0,19
			911 Freddie Mac Pool 'SD1749', 2,500 %, fällig am 04.01.2052	758	0,09
			621 Freddie Mac Pool 'SD1751', 2,500 %, fällig am 10.01.2051	519	0,06
			646 Freddie Mac Pool 'SD1807', 4,500 %, fällig am 07.01.2052	615	0,08
			192 Freddie Mac Pool 'SD2138', 5,500 %, fällig am 01.01.2053	192	0,02
			284 Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	282	0,03
			723 Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, fällig am 12.01.2052	731	0,09
			371 Freddie Mac Pool 'SD2374', 5,000 %, fällig am 01.01.2053	361	0,04
			448 Freddie Mac Pool 'SD2395', 5,000 %, fällig am 01.01.2053	435	0,05
			451 Freddie Mac Pool 'SD2452', 6,500 %, fällig am 02.01.2053	461	0,06
			267 Freddie Mac Pool 'SD2549', 4,000 %, fällig am 07.01.2052	250	0,03
			182 Freddie Mac Pool 'SD2588', 4,000 %, fällig am 07.01.2050	172	0,02
			652 Freddie Mac Pool 'SD2591', 5,000 %, fällig am 03.01.2053	637	0,08
			755 Freddie Mac Pool 'SD2688', 5,500 %, fällig am 04.01.2053	750	0,09
			88 Freddie Mac Pool 'SD2715', 4,500 %, fällig am 09.01.2050	84	0,01
			471 Freddie Mac Pool 'SD2723', 5,500 %, fällig am 03.01.2053	469	0,06
			670 Freddie Mac Pool 'SD2762', 5,500 %, fällig am 05.01.2053	667	0,08
			277 Freddie Mac Pool 'SD2763', 5,500 %, fällig am 04.01.2053	275	0,03
			177 Freddie Mac Pool 'SD2792', 4,500 %, fällig am 03.01.2047	173	0,02
			188 Freddie Mac Pool 'SD2856', 5,500 %, fällig am 05.01.2053	186	0,02
			281 Freddie Mac Pool 'SD2866', 4,000 %, fällig am 07.01.2049	264	0,03
			466 Freddie Mac Pool 'SD2892', 5,500 %, fällig am 05.01.2053	463	0,06
			1.962 Freddie Mac Pool 'SD2919', 5,500 %, fällig am 04.01.2053	1.944	0,24
			185 Freddie Mac Pool 'SD2961', 5,000 %, fällig am 11.01.2052	180	0,02
			182 Freddie Mac Pool 'SD2981', 6,500 %, fällig am 05.01.2053	186	0,02
			376 Freddie Mac Pool 'SD3171', 5,500 %, fällig am 06.01.2053	373	0,05

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert		
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)							
131	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig am 20.07.2048	127	0,02	111	Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Class IO, 0,526 %, fällig am 16.02.2059 *	28	–
292	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, fällig am 20.08.2048	283	0,03	803	Government National Mortgage Association, Series 2017 157, Class IO, 0,504 %, fällig am 16.12.2059 *	28	–
262	Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig am 20.10.2048	254	0,03	823	Government National Mortgage Association, Series 2017 28, Class IO, 0,687 %, fällig am 16.02.2057 *	28	–
402	Ginnie Mae II Pool 'MA5530', 5,000 %, fällig am 20.10.2048	399	0,05	490	Government National Mortgage Association, Series 2017 41, Class IO, 0,584 %, fällig am 16.07.2058 *	14	–
156	Ginnie Mae II Pool 'MA5594', 3,500 %, fällig am 20.11.2048	143	0,02	98	Government National Mortgage Association, Series 2017 H15, Class KI, 0,835 %, fällig am 20.07.2067 *	5	–
365	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, fällig am 20.11.2048	362	0,04	3.897	Government National Mortgage Association, Series 2017 H18, Class BI, 0,048 %, fällig am 20.09.2067 *	168	0,02
254	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig am 20.12.2048	245	0,03	50	Government National Mortgage Association, Series 2017 H20, Class IB, 0,252 %, fällig am 20.10.2067 *	2	–
267	Ginnie Mae II Pool 'MA5653', 5,000 %, fällig am 20.12.2048	265	0,03	164	Government National Mortgage Association, Series 2018 H06, Class PF, 5,763 %, fällig am 20.02.2068 *	162	0,02
1.078	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, fällig am 20.01.2049	1.066	0,13	321	Government National Mortgage Association, Series 2018 H07, Class FD, 5,763 %, fällig am 20.05.2068 *	321	0,04
656	Ginnie Mae II Pool 'MA5763', 4,000 %, fällig am 20.02.2049	620	0,08	261	Government National Mortgage Association, Series 2019 90, Class AB, 3,000 %, fällig am 20.07.2049	228	0,03
200	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig am 20.03.2049	194	0,02	1.448	Government National Mortgage Association, Series 2020 103, Class AD, 1,450 %, fällig am 16.01.2063	1.093	0,13
171	Ginnie Mae II Pool 'MA5819', 5,000 %, fällig am 20.03.2049	169	0,02	274	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class IL, 2,500 %, fällig am 20.08.2050	34	–
86	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig am 20.04.2049	83	0,01	876	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class NI, 2,500 %, fällig am 20.08.2050	116	0,01
225	Ginnie Mae II Pool 'MA5878', 5,000 %, fällig am 20.04.2049	222	0,03	427	Government National Mortgage Association, Series 2020 127, Class IN, 2,500 %, fällig am 20.08.2050	57	0,01
104	Ginnie Mae II Pool 'MA6157', 5,000 %, fällig am 20.09.2049	103	0,01	375	Government National Mortgage Association, Series 2020 129, Class IE, 2,500 %, fällig am 20.09.2050	50	0,01
109	Ginnie Mae II Pool 'MA6287', 5,000 %, fällig am 20.11.2049	109	0,01	15.741	Government National Mortgage Association, Series 2020 157, Class IO, 0,935 %, fällig am 16.06.2062 *	972	0,12
270	Ginnie Mae II Pool 'MA6342', 5,000 %, fällig am 20.12.2049	268	0,03	233	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig am 20.10.2050	31	–
336	Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, fällig am 20.01.2050	333	0,04	297	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig am 20.10.2050	42	0,01
164	Ginnie Mae II Pool 'MA6603', 5,000 %, fällig am 20.04.2050	163	0,02	1.279	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class YI, 2,500 %, fällig am 20.10.2050	166	0,02
121	Ginnie Mae II Pool 'MA6818', 2,000 %, fällig am 20.08.2050	99	0,01	1.385	Government National Mortgage Association, Series 2020 173, Class MI, 2,500 %, fällig am 20.11.2050	188	0,02
1.041	Ginnie Mae II Pool 'MA6930', 2,000 %, fällig am 20.10.2050	848	0,10	12.083	Government National Mortgage Association, Series 2020 178, Class IO, 1,422 %, fällig am 16.10.2060 *	1.076	0,13
205	Ginnie Mae II Pool 'MA6997', 3,500 %, fällig am 20.11.2050	187	0,02	2.781	Government National Mortgage Association, Series 2020 181, Class WI, 2,000 %, fällig am 20.12.2050	311	0,04
405	Ginnie Mae II Pool 'MA6999', 4,500 %, fällig am 20.11.2050	387	0,05	718	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050	130	0,02
1.837	Ginnie Mae II Pool 'MA7051', 2,000 %, fällig am 20.12.2050	1.497	0,18	273	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050	50	0,01
76	Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, fällig am 20.12.2050	74	0,01	787	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class FL, 6,613 %, fällig am 20.05.2070 *	786	0,10
2.489	Ginnie Mae II Pool 'MA7135', 2,000 %, fällig am 20.01.2051	2.029	0,25	150	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class NF, 6,713 %, fällig am 20.04.2070 *	151	0,02
298	Ginnie Mae II Pool 'MA7136', 2,500 %, fällig am 20.01.2051	253	0,03	98	Government National Mortgage Association, Series 2020 H12, Class F, 5,963 %, fällig am 20.07.2070 *	96	0,01
5.973	Ginnie Mae II Pool 'MA7192', 2,000 %, fällig am 20.02.2051	4.868	0,60	372	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FA, 5,913 %, fällig am 20.07.2070 *	361	0,04
99	Ginnie Mae II Pool 'MA7194', 3,000 %, fällig am 20.02.2051	88	0,01	93	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FC, 5,913 %, fällig am 20.07.2070 *	91	0,01
1.020	Ginnie Mae II Pool 'MA7368', 3,000 %, fällig am 20.05.2051	895	0,11	933	Government National Mortgage Association, Series 2021 14, Class AB, 1,340 %, fällig am 16.06.2063	697	0,09
619	Ginnie Mae II Pool 'MA7472', 2,500 %, fällig am 20.07.2051	525	0,06	1.814	Government National Mortgage Association, Series 2021 21, Class AH, 1,400 %, fällig am 16.06.2063	1.358	0,17
867	Ginnie Mae II Pool 'MA7534', 2,500 %, fällig am 20.08.2051	735	0,09	25.223	Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,112 %, fällig am 16.01.2061 *	1.948	0,24
1.927	Ginnie Mae II Pool 'MA7589', 2,500 %, fällig am 20.09.2051	1.632	0,20	1.057	Government National Mortgage Association, Series 2021 77, Class LC, 1,250 %, fällig am 20.07.2050	824	0,10
375	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig am 20.09.2051	329	0,04	1.500	Government National Mortgage Association, Series 2022 139, Class AL, 4,000 %, fällig am 20.07.2051	1.339	0,16
831	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000 %, fällig am 20.10.2052	813	0,10	1.731	Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig am 16.02.2061 *	85	0,01
1.028	Ginnie Mae II Pool 'MA8428', 5,000 %, fällig am 20.11.2052	1.005	0,12	200	Government National Mortgage Association, Series 2022 63, Class LM, 3,500 %, fällig am 20.10.2050	166	0,02
734	Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500 %, fällig am 20.11.2052	731	0,09	8.253	Government National Mortgage Association, Series 2023 179, Class IO, 0,611 %, fällig am 16.09.2063 *	339	0,04
188	Ginnie Mae II Pool 'MA8490', 5,000 %, fällig am 20.12.2052	183	0,02	3.000	Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class AH, 2,000 %, fällig am 16.06.2064	2.309	0,28
1.609	Ginnie Mae II Pool 'MA8569', 5,000 %, fällig am 20.01.2053	1.573	0,19	2.000	Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class IA, 0,611 %, fällig am 16.06.2064 *	125	0,02
378	Ginnie Mae II Pool 'MA8726', 5,500 %, fällig am 20.03.2053	376	0,05	2.831	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class A, 144A, 7,165 %, fällig am 15.09.2031 *	2.024	0,25
458	Ginnie Mae II Pool 'MA8796', 3,000 %, fällig am 20.04.2053	404	0,05	2.145	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class B, 144A, 8,365 %, fällig am 15.09.2031 *	730	0,09
1.623	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	1.613	0,20	242	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Series 2014 GC20, Class XA, 0,844 %, fällig am 10.04.2047 *	–	–
3.002	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig am 20.05.2053	2.985	0,37	14	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, Series 2007 7, Class 2A1A, 6,435 %, fällig am 25.10.2037 *	13	–
9.200	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	8.987	1,10	–	Impac Secured Assets Trust 2006-4, Series 2006 4, Class A2B, 5,775 %, fällig am 25.01.2037 **	–	–
4.700	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	4.669	0,57	3.980	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHH, Series 2018 PHH, Class F, 144A, 8,675 %, fällig am 15.06.2035 *†	241	0,03

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
3.730			440		
				432	0,05
				20	–
1.754	355	0,04	930	887	0,11
169	1.718	0,21	390	374	0,05
160	147	0,02		3.500	0,43
2.736	141	0,02	China – 0,32 % (28. Februar 2023: 0,30 %)		
280	2.724	0,34	40	39	–
2.870	253	0,03	1.930	1.559	0,19
316	2.621	0,32	1.660	1.024	0,13
569	288	0,04		2.622	0,32
794	536	0,07	Kolumbien – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,13 %)		
99	720	0,09	940	778	0,09
530	91	0,01	960	712	0,09
2.694	504	0,06		1.490	0,18
690	2.786	0,34	Dänemark – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,19 %)		
471	647	0,08	280	274	0,03
72.169	443	0,05	2.040	1.965	0,24
141	122	0,02		2.239	0,27
250	241	0,03	Frankreich – 1,49 % (28. Februar 2023: 1,08 %)		
160	153	0,02	1.260	1.207	0,15
4.796	134	0,02	620	602	0,07
2.010	1.898	0,23	2.890	2.646	0,33
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 388.387 \$)			352.010	43,18	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 36,66 % (28. Februar 2023: 36,53 %)					
Australien – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,04 %)					
140	134	0,02	1.260	1.207	0,15
200	165	0,02	620	602	0,07
	299	0,04	2.890	2.646	0,33
Belgien – 0,43 % (28. Februar 2023: 0,40 %)			870	839	0,10
750	694	0,09	1.620	1.609	0,20
680	660	0,08	360	356	0,04
280	259	0,03	550	517	0,06
920	824	0,10	990	1.013	0,13
1.060	1.087	0,13	410	411	0,05
	3.524	0,43	710	734	0,09
Brazilien – 0,65 % (28. Februar 2023: 0,67 %)			500	498	0,06
2.820	2.798	0,34	590	545	0,07
290	271	0,03	240	227	0,03
190	166	0,02	940	927	0,11
1.870	1.537	0,19		12.131	1,49
60	65	0,01	Indien – 0,13 % (28. Februar 2023: 0,10 %)		
410	438	0,06	330	280	0,04
	5.275	0,65	1.020	743	0,09
Kanada – 0,43 % (28. Februar 2023: 0,34 %)				1.023	0,13
120	112	0,01	Irland – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,38 %)		
110	99	0,01	1.480	1.366	0,17
160	147	0,02	1.000	899	0,11
200	179	0,02	480	406	0,05
290	295	0,04		2.671	0,33
500	513	0,06	Israel – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,42 %)		
650	442	0,06	590	593	0,07
			1.570	1.456	0,18
China – 0,32 % (28. Februar 2023: 0,30 %)			430	410	0,05
			530	501	0,06
			240	260	0,03
				3.220	0,39
Dänemark – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,19 %)					
			Italien – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,17 %)		
			1.160	1.153	0,14
			850	842	0,10
				1.995	0,24
Frankreich – 1,49 % (28. Februar 2023: 1,08 %)					
			Japan – 0,37 % (28. Februar 2023: 0,37 %)		
			560	542	0,07
			1.600	1.539	0,19
			990	941	0,11
				3.022	0,37
Indien – 0,13 % (28. Februar 2023: 0,10 %)					
			Kasachstan – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,05 %)		
			200	171	0,02
			520	475	0,06
				646	0,08
Irland – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,38 %)					
			Kuwait – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,04 %)		
			320	308	0,04

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
			1.590 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig am 31.03.2031 *	1.503	0,18
			1.180 Citigroup Inc, 2,520 %, fällig am 03.11.2032 *	958	0,12
			180 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig am 17.03.2033 *	159	0,02
			540 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig am 24.05.2033 *	517	0,06
			1.456 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	1.850	0,23
			5 Citigroup Inc, 5,300 %, fällig am 06.05.2044	5	–
			390 Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Ewige Anleihe *	387	0,05
			90 Citigroup Inc, Series M, 6,300 %, Ewige Anleihe *	90	0,01
			20 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig am 01.06.2040	14	–
			680 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig am 15.11.2033	698	0,09
			20 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, fällig am 15.11.2053	21	–
			10 Comcast Corp, 3,950 %, fällig am 15.10.2025	10	–
			60 Comcast Corp, 3,150 %, fällig am 01.03.2026	58	0,01
			20 Comcast Corp, 3,300 %, fällig am 01.04.2027	19	–
			700 Comcast Corp, 4,150 %, fällig am 15.10.2028	679	0,08
			390 Comcast Corp, 3,400 %, fällig am 01.04.2030	357	0,04
			510 Comcast Corp, 4,250 %, fällig am 15.10.2030	488	0,06
			60 Comcast Corp, 4,250 %, fällig am 15.01.2033	56	0,01
			60 Comcast Corp, 5,650 %, fällig am 15.06.2035	62	0,01
			13 Comcast Corp, 6,500 %, fällig am 15.11.2035	14	–
			1.420 Comcast Corp, 3,900 %, fällig am 01.03.2038	1.219	0,15
			400 Comcast Corp, 3,250 %, fällig am 01.11.2039	307	0,04
			300 Comcast Corp, 3,750 %, fällig am 01.04.2040	246	0,03
			80 Comcast Corp, 3,400 %, fällig am 15.07.2046	59	0,01
			120 Comcast Corp, 4,000 %, fällig am 15.08.2047	96	0,01
			224 Comcast Corp, 3,969 %, fällig am 01.11.2047	178	0,02
			110 Comcast Corp, 4,000 %, fällig am 01.03.2048	87	0,01
			293 Comcast Corp, 3,999 %, fällig am 01.11.2049	233	0,03
			200 Comcast Corp, 3,450 %, fällig am 01.02.2050	144	0,02
			619 Comcast Corp, 2,887 %, fällig am 01.11.2051	392	0,05
			66 Comcast Corp, 4,049 %, fällig am 01.11.2052	52	0,01
			137 Comcast Corp, 2,937 %, fällig am 01.11.2056	84	0,01
			100 Comcast Corp, 4,950 %, fällig am 15.10.2058	93	0,01
			74 Comcast Corp, 2,987 %, fällig am 01.11.2063	45	–
			20 CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig am 01.11.2042	17	0,01
			300 CommScope Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 01.03.2026	270	0,03
			130 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.09.2029	89	0,01
			85 ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig am 15.04.2029	93	0,01
			240 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig am 01.04.2030	220	0,03
			190 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig am 01.04.2050	152	0,02
			440 Constellation Brands Inc, 4,750 %, fällig am 15.11.2024	438	0,05
			450 Constellation Brands Inc, 4,350 %, fällig am 09.05.2027	440	0,05
			10 Continental Resources Inc/OK, 3,800 %, fällig am 01.06.2024	10	–
			290 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, fällig am 15.11.2026	266	0,03
			1.000 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig am 15.01.2028	962	0,12
			390 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig am 15.01.2031	383	0,05
			100 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig am 01.06.2044	81	0,01
			1.790 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig am 15.05.2027	1.722	0,21
			560 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig am 15.03.2029	540	0,07
			300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 01.12.2030	224	0,03
			200 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig am 15.02.2031	141	0,02
			510 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig am 15.11.2031	379	0,05
			171 CVS Health Corp, 3,875 %, fällig am 20.07.2025	168	0,02
			220 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig am 01.04.2027	211	0,03
			268 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig am 25.03.2028	260	0,03
			530 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig am 01.04.2030	489	0,06
			410 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig am 15.09.2031	331	0,04
			400 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig am 25.03.2038	364	0,04
			220 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig am 01.04.2040	181	0,02
			440 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig am 20.07.2045	401	0,05
			2.190 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig am 25.03.2048	1.955	0,24
			70 CVS Health Corp, 4,250 %, fällig am 01.04.2050	56	0,01
			13 CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, fällig am 10.12.2028	14	–
			26 CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, fällig am 10.01.2030	26	–
			150 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig am 03.11.2036	155	0,02
			630 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig am 15.01.2026	650	0,08
			50 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig am 15.12.2025	50	0,01
			260 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig am 15.01.2030	248	0,03
			40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig am 15.07.2041	38	–
			520 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig am 15.05.2042	440	0,05
			1.480 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig am 15.06.2045	1.282	0,16
			50 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig am 01.12.2026	48	0,01
			660 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig am 01.12.2029	606	0,07
			320 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig am 24.03.2051	259	0,03
			450 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig am 15.11.2024	426	0,05
			410 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig am 01.07.2026	262	0,03
			230 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig am 01.12.2026	184	0,02
			40 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig am 01.12.2028	28	–
			170 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig am 01.06.2029	73	0,01
			130 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig am 15.02.2040	128	0,02
			200 Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, fällig am 01.02.2029	189	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)						
USA – (Fortsetzung)						
			670	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig am 01.02.2041	722	0,09
			160	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, fällig am 22.04.2042 *	119	0,01
			380	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,908 %, fällig am 21.07.2042 *	270	0,03
			40	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig am 22.05.2045	38	–
			540	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig am 21.10.2045	494	0,06
			580	Haleon US Capital LLC, 3,375 %, fällig am 24.03.2027	551	0,07
			410	Haleon US Capital LLC, 3,375 %, fällig am 24.03.2029	379	0,05
			370	Haleon US Capital LLC, 3,625 %, fällig am 24.03.2032	332	0,04
			60	Halliburton Co, 4,850 %, fällig am 15.11.2035	58	0,01
			320	Halliburton Co, 5,000 %, fällig am 15.11.2045	298	0,04
			100	HCA Inc, 5,000 %, fällig am 15.03.2024	100	0,01
			20	HCA Inc, 5,375 %, fällig am 01.02.2025	20	–
			10	HCA Inc, 5,250 %, fällig am 15.04.2025	10	–
			170	HCA Inc, 5,250 %, fällig am 15.06.2026	169	0,02
			30	HCA Inc, 5,375 %, fällig am 01.09.2026	30	–
			90	HCA Inc, 5,625 %, fällig am 01.09.2028	91	0,01
			660	HCA Inc, 5,875 %, fällig am 01.02.2029	672	0,08
			930	HCA Inc, 3,500 %, fällig am 01.09.2030	831	0,10
			110	HCA Inc, 5,500 %, fällig am 15.06.2047	103	0,01
			380	Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig am 15.04.2027	354	0,04
			70	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig am 06.12.2028	68	0,01
			440	Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig am 15.04.2030	389	0,05
			360	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig am 15.04.2040	282	0,03
			90	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig am 15.06.2047	73	0,01
			1.120	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig am 15.04.2050	812	0,10
			430	Humana Inc, 3,950 %, fällig am 15.03.2027	415	0,05
			360	Humana Inc, 3,125 %, fällig am 15.08.2029	326	0,04
			190	Humana Inc, 2,150 %, fällig am 03.02.2032	151	0,02
			70	Humana Inc, 4,625 %, fällig am 01.12.2042	62	0,01
			20	Humana Inc, 4,800 %, fällig am 15.03.2047	17	–
			50	ILFC E-Capital Trust II, 144A, 7,436 %, fällig am 21.12.2065 *	40	–
			350	Intel Corp, 1,600 %, fällig am 12.08.2028	305	0,04
			240	Intel Corp, 5,125 %, fällig am 10.02.2030	242	0,03
			130	Intel Corp, 3,734 %, fällig am 08.12.2047	99	0,01
			380	Intel Corp, 4,750 %, fällig am 25.03.2050	339	0,04
			10	Intel Corp, 3,050 %, fällig am 12.08.2051	7	–
			250	Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, fällig am 15.03.2033	239	0,03
			790	Johnson & Johnson, 3,625 %, fällig am 03.03.2037	699	0,09
			20	JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, fällig am 10.09.2024	20	–
			370	JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig am 22.04.2026 *	356	0,04
			1.000	JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, fällig am 23.01.2029 *	942	0,12
			610	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig am 23.07.2029 *	586	0,07
			780	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig am 05.12.2029 *	755	0,09
			640	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig am 22.04.2031 *	548	0,07
			790	JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, fällig am 08.11.2032 *	651	0,08
			270	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig am 01.06.2045	254	0,03
			300	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig am 22.04.2051 *	206	0,03
			700	Kenvue Inc, 4,900 %, fällig am 22.03.2033	692	0,08
			20	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig am 01.06.2025	20	–
			350	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig am 01.03.2028	340	0,04
			270	Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig am 01.12.2034	263	0,03
			140	Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig am 01.06.2045	132	0,02
			10	Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig am 01.03.2048	9	–
			30	KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, fällig am 01.02.2043	29	–
			520	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig am 15.07.2045	486	0,06
			1.750	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	1.729	0,21
			1.320	Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig am 25.06.2025	1.263	0,16
			140	Las Vegas Sands Corp, 3,900 %, fällig am 08.08.2029	127	0,02
			160	Lehman Brothers Escrow, Series DMTN, Nullkupon, Ewige Anleihe ¹⁼⁰⁼⁰	–	–
			10	Lennar Corp, 4,500 %, fällig am 30.04.2024	10	–
			50	Lennar Corp, 4,750 %, fällig am 30.05.2025	50	0,01
			460	Lennar Corp, 4,750 %, fällig am 29.11.2027	453	0,06
			280	Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig am 15.04.2030	272	0,03
			300	Mars Inc, 144A, 3,200 %, fällig am 01.04.2030	272	0,03
			110	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig am 26.03.2050	91	0,01
			100	McDonald's Corp, 1,450 %, fällig am 01.09.2025	95	0,01
			40	McDonald's Corp, 3,700 %, fällig am 30.01.2026	39	–
			310	McDonald's Corp, 3,500 %, fällig am 01.03.2027	299	0,04
			360	McDonald's Corp, 3,500 %, fällig am 01.07.2027	345	0,04
			260	McDonald's Corp, 3,800 %, fällig am 01.04.2028	250	0,03
			130	McDonald's Corp, 3,600 %, fällig am 01.07.2030	121	0,01
			80	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig am 01.09.2049	60	0,01
			600	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig am 01.04.2050	497	0,06
			60	MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig am 15.01.2043	60	0,01
			450	Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig am 24.06.2030	368	0,05
			790	Merck & Co Inc, 2,750 %, fällig am 10.12.2051	510	0,06
			300	MetLife Inc, 6,400 %, fällig am 15.12.2036	305	0,04
			320	Micron Technology Inc, 5,300 %, fällig am 15.01.2031	317	0,04
			230	Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig am 09.02.2033	235	0,03
			10	Microsoft Corp, 2,921 %, fällig am 17.03.2052	7	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
			190	164	0,02
				32.917	4,04
420	411	0,05	190 Internationale Staatsanleihe Mexiko, 5,750 %, fällig am 12.10.2110		
610	585	0,07	Nigeria – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,02 %)		
870	823	0,10	300	274	0,04
880	854	0,10	300 Internationale Staatsanleihe Nigeria, 144A, 6,500 %, fällig am 28.11.2027		
560	531	0,07	Paraguay – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,04 %)		
750	684	0,08	470	406	0,05
370	354	0,04	470 Internationale Staatsanleihe Paraguay, 144A, 3,849 %, fällig am 28.06.2033		
320	322	0,04	Peru – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,10 %)		
1.040	912	0,11	730	622	0,08
620	590	0,07	730 Internationale Staatsanleihe Peru, 2,783 %, fällig am 23.01.2031		
330	283	0,03	480	276	0,03
410	409	0,05	480 Internationale Staatsanleihe Peru, 2,780 %, fällig am 01.12.2060		
520	461	0,06	USA – 5,22 % (28. Februar 2023: 16,97 %)		
650	536	0,07	1.440	1.626	0,20
100	87	0,01	830	822	0,10
4.490	4.155	0,51	7.050	6.797	0,83
130	130	0,02	7.050 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig am 15.01.2033 β		
50	49	0,01	10	10	–
110	105	0,01	10 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig am 30.09.2028		
1.340	1.240	0,15	190	186	0,02
40	34	–	11.790	11.600	1,42
130	114	0,01	190 United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig am 31.12.2028		
180	159	0,02	5.390	5.384	0,66
350	390	0,05	5.390 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig am 28.02.2031		
760	836	0,10	940	920	0,11
718	857	0,11	940 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig am 15.08.2043		
660	645	0,08	5.300	5.456	0,67
110	118	0,01	5.300 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig am 15.11.2043		
	219.191	26,89	1.260	785	0,10
			1.260 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig am 15.02.2050		
Sambia – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,06 %)			2.970	1.560	0,19
680	647	0,08	2.970 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig am 15.08.2050		
			1.270	713	0,09
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 328.435 \$)	298.865	36,66	1.270 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig am 15.11.2050		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 10,98 % (28. Februar 2023: 23,40 %)			300	180	0,02
Argentinien – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,18 %)			300 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig am 15.02.2051		
596	274	0,03	370	250	0,03
1.062	396	0,05	370 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig am 15.05.2051		
1.850	668	0,08	2.910	1.793	0,22
1.865	725	0,09	2.910 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig am 15.08.2051		
757	295	0,04	2.040	1.954	0,24
	2.358	0,29	2.040 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 15.08.2053		
			430	457	0,06
Brasilien – 0,75 % (28. Februar 2023: 1,02 %)			430 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig am 15.11.2053		
BRL	2.813	0,34	2.120	2.081	0,26
BRL	2.828	0,35	2.120 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig am 15.02.2054		
640	475	0,06	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 94.550 \$)		
	6.116	0,75	89.472		
			10,98		
Kolumbien – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,17 %)			Schuldscheindarlehen – 2,78 % (28. Februar 2023: 4,08 %)		
890	688	0,08	538	538	0,07
900	602	0,07	442	441	0,05
670	526	0,07	401	402	0,03
	1.816	0,22	1.069	1.065	0,13
Israel – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,08 %)			764	761	0,09
650	557	0,07	162	162	0,02
390	262	0,03	742	740	0,09
	819	0,10	742 Brown Group Holding LLC, 8,183 %, fällig am 07.06.2028 *		
Kenia – 0,16 % (28. Februar 2023: 0,15 %)			89	90	0,01
1.640	1.294	0,16	89 Caesars Entertainment, 8,663 %, fällig am 25.01.2030 *		
			105	105	0,01
Mexiko – 4,04 % (28. Februar 2023: 3,56 %)			105 Castlelake Aviation One Dac, 8,135 %, fällig am 22.10.2026 *		
MXN	1.451	0,18	892	892	0,11
MXN	10.339	1,27	347	346	0,04
MXN	11.795	1,45	892 Citadel Securities LP, 7,836 %, fällig am 29.07.2030 *		
MXN	7.278	0,89	1.168	1.161	0,14
	1.890	0,23	1.168 DCert Buyer, Inc., 9,333 %, fällig am 16.10.2026 *		
			1.016	1.005	0,12
			1.016 Deerfield Dakota Holding LLC, 9,098 %, fällig am 05.03.2027 *		
			231	230	0,03
			231 First Eagle Holdings Inc, 7,948 %, fällig am 17.02.2027 *		
			853	849	0,11
			853 Focus Financial Partners LLC, 8,083 %, fällig am 30.06.2028 *		
			1.826	1.751	0,22
			1.826 Gainwell Acquisition Corp, 9,448 %, fällig am 01.10.2027 *		
			350	351	0,04
			350 Garda World Security Corp, 9,625 %, fällig am 01.02.2029 *		
			1.887	1.889	0,23
			1.887 Genesee & Wyoming Inc, 7,448 %, fällig am 30.12.2026 *		
			957	941	0,12
			957 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,538 %, fällig am 15.11.2027 *		
			841	837	0,10
			841 Harbor Freight Tools USA Inc, 8,197 %, fällig am 19.10.2027 *		
			607	608	0,07
			607 ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,860 %, fällig am 01.07.2028 *		
			151	151	0,02
			151 Indigo Merger Sub, Inc., 7,860 %, fällig am 01.07.2028 *		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Schuldscheindarlehen – (Fortsetzung)					
228 Mozart Borrower LP, 8,451 %, fällig am 30.09.2028 *	228	0,03			
259 PCI Gaming Authority, 7,947 %, fällig am 31.05.2026 *	259	0,03			
843 Phoenix Guarantor Inc, 0,000 %, fällig am 13.02.2031 *	835	0,10			
609 Quikrete Holdings, Inc., 8,197 %, fällig am 18.03.2029 *	610	0,08			
1.110 SkyMiles IP Ltd, 9,068 %, fällig am 20.10.2027 *	1.143	0,14			
1.400 Sotera Health, 8,197 %, fällig am 13.12.2026 *	1.397	0,17			
1.271 Station Casinos LLC, 7,683 %, fällig am 08.02.2027 *	1.270	0,16			
1.057 UFC Holdings LLC, 8,336 %, fällig am 29.04.2026 *	1.059	0,13			
552 Virgin Media Bristol LLC, 7,932 %, fällig am 04.01.2028 *	548	0,07			
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 22.736 \$)	22.664	2,78			
Stammaktien – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
Schweiz – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
2.840 Credit Suisse Group AG Escrow †∞	348	0,04			
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)	348	0,04			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 888.917 \$)					
	813.413	99,78			
Kontrakte (in Tsd.)					
Gekaufte Optionen – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,05 %)					
– CME 3 Month SOFR Futures April 2024 Put 94,75, fällig am 12.04.2024 – Morgan Stanley	14	–			
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Put 96,00, fällig am 13.12.2024 – Morgan Stanley	190	0,03			
– CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 94,6250, fällig am 15.03.2024 – Morgan Stanley	14	–			
– CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Put 94,50, fällig am 15.03.2024 – Morgan Stanley	2	–			
– U.S. 10 Year April 2024 Put 109,75, fällig am 22.03.2024 – Morgan Stanley	21	–			
– U.S. 10 Year May 2024 Call 111,00, fällig am 26.04.2024 – Morgan Stanley	24	0,01			
– U.S. 2 Year Juni 2024 Call 103,50, fällig am 24.05.2024 – Morgan Stanley	6	–			
– U.S. 5 Year April 2024 Call 108,00, fällig am 22.03.2024 – Morgan Stanley	11	–			
– U.S. 5 Year W1 März 2024 Put 106,50, fällig am 01.03.2024 – Morgan Stanley	2	–			
6.110 USD Call/CAD Put 1,3720, fällig am 22.03.2024 – BNP Paribas	9	–			
7.020 USD Call/CHF Put 0,8725, fällig am 16.03.2024 – Goldman Sachs	94	0,01			
7.910 USD Call/EUR Put 1,0808, fällig am 12.03.2024 – Citi	34	0,01			
6.436 USD Put/AUD Call 0,6686, fällig am 18.04.2024 – BNP Paribas	18	–			
6.980 USD Put/JPY Call 143,42, fällig am 19.04.2024 – BNP Paribas	21	–			
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 621 \$)	460	0,06			
Credit Default Swaps – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,19 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	3.206	0,39			
Index-Swaps – 0,88 % (28. Februar 2023: 0,53 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	7.135	0,88			
Devisenterminkontrakte – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,05 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	416	0,05			
Futures – 0,19 % (28. Februar 2023: 0,22 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.495	0,19			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	826.125	101,35			
Nennwert (in Tsd.)					
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – -0,72 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
(7.100) Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	-5.842	-0,72			
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten -5.828 \$)	-5.842	-0,72			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten -5.828 \$)					
	-5.842	-0,72			
Kontrakte (in Tsd.)					
Verkaufte Optionen – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,06 %)					
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Call 97,1250, fällig am 13.12.2024 – Morgan Stanley	-23	-0,01			
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Put 95,50, fällig am 13.12.2024 – Morgan Stanley	-102	-0,01			
– CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 95,25, fällig am 15.03.2024 – Morgan Stanley	-1	–			
Kontrakte (in Tsd.)					
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -356 \$)					
	-215	-0,03			
Credit Default Swaps – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,01 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-459	-0,05			
Index-Swaps – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,04 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-146	-0,02			
Zinsswaps – 0,13 % (28. Februar 2023: -0,11 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.035	-0,13			
Devisenterminkontrakte – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,23 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.408	-0,17			
Futures – 0,07 % (28. Februar 2023: 0,32 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-552	-0,07			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
	-9.657	-1,19			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
	816.468	100,16			
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten					
	-1.213	-0,16			
Gesamtvermögen					
	815.255 \$	100,00			
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 116.018.000 USD und machten 14,25 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.					
† Nicht liquide.					
∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.					
± Das Wertpapier ist zum 29. Februar 2024 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).					
ε Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.					
β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.					
ABKÜRZUNGEN:					
Ewige Anleihe	–	Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.			
REMIC	–	Real Estate Mortgage Investment Conduit.			
TBA	–	To be announced.			
BRL	–	Brasilianischer Real			
INR	–	Indische Rupie			
MXN	–	Mexikanischer Peso			
Verteilung des Gesamtvermögens					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
					92,02
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden					
					2,64
Finanzderivate					
					1,48
Sonstige Vermögenswerte					
					3,86
Gesamtvermögen					
					100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.HY.CDSI 5 Year, 5,000 % – Kauf	20. Dez. 2028	7.311	\$ -459
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	155.474	3.188
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2033	3.640	18
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.240 \$)				\$ 3.206
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -158 \$)				-459
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.082 \$)				\$ 2.747

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 10,262 %	2. Jan. 2029	82.920	\$ -106
Morgan Stanley	Zahlt variablen Zinssatz zum MXN TIE Banxico, erhält festen Zinssatz von 7,450 %	18. Juli 2029	142.060	-453
Morgan Stanley	Zahlt variablen Zinssatz zum MXN TIE Banxico, erhält festen Zinssatz von 7,440 %	20. Juli 2029	147.960	-476
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): - \$)				\$ -
Nicht realisierte Wertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.287 \$)				-1.035
Nettowertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.287 \$)				\$ -1.035

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 2,600 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	6.547	\$ 1.189
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,050 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	44.763	4.992
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,150 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Mai 2048	86	8
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,530 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	31. Okt. 2030	15.568	360
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,540 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	31. Okt. 2030	26.001	586
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,870 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	28. Feb. 2031	4.547	-4
Morgan Stanley	Zahlt variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound, erhält festen Zinssatz von 3,500 %	30. Sep. 2024	13.390	-142
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 6.036 \$)				\$ 7.135
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -422 \$)				-146
Nettowertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 5.614 \$)				\$ 6.989

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2024	Citi	Kauf	EUR 2.500	Verkauf	USD 2.712	\$ -10
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD 33	Verkauf	AUD 53	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD 33	Verkauf	AUD 51	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD 41	Verkauf	EUR 38	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD 9	Verkauf	EUR 8	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD -	Verkauf	GBP -	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD 896	Verkauf	USD 584	-2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR 10	Verkauf	USD 11	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP 27	Verkauf	USD 34	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR 786	Verkauf	USD 845	5
19. Apr. 2024	BNP Paribas	Kauf	NOK 66.018	Verkauf	EUR 5.823	-83
19. Apr. 2024	Citi	Kauf	USD 2.927	Verkauf	CAD 3.910	43
19. Apr. 2024	Citi	Kauf	USD 938	Verkauf	EUR 870	-4
19. Apr. 2024	Citi	Kauf	USD 5.433	Verkauf	EUR 4.990	29
19. Apr. 2024	Citi	Kauf	USD 7.027	Verkauf	GBP 5.511	68
19. Apr. 2024	Citi	Kauf	USD 491	Verkauf	MXN 8.468	-1
19. Apr. 2024	Citi	Kauf	IDR 2.499.385	Verkauf	USD 160	-1
19. Apr. 2024	Citi	Kauf	EUR 3.410	Verkauf	USD 3.751	-57
19. Apr. 2024	Citi	Kauf	AUD 13.061	Verkauf	USD 8.757	-254
19. Apr. 2024	Citi	Kauf	GBP 1.024	Verkauf	USD 1.307	-14
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD 2.159	Verkauf	CHF 1.890	11
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD 1.762	Verkauf	EUR 1.620	6
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD 407	Verkauf	MXN 6.970	2
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD 1.756	Verkauf	MXN 30.310	-7
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	CHF 1.440	Verkauf	USD 1.635	2
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	EUR 132	Verkauf	USD 143	-1
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	USD 13.340	Verkauf	CNH 94.905	127
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	USD 161	Verkauf	IDR 2.499.385	3
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	USD 844	Verkauf	MXN 14.460	3
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	USD 4.428	Verkauf	MXN 76.470	-23

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung aus Kontrakten (in Tsd.)			
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	MXN	13.220	Verkauf	USD	769	\$	–
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	USD	3.854	Verkauf	JPY	556.980		108
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	CAD	12.027	Verkauf	USD	8.982		-114
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	INR	156.175	Verkauf	USD	1.871		9
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	JPY	2.944.327	Verkauf	USD	20.640		-837
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 540 \$)								\$	416
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.578 \$)									-1.408
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.038 \$)								\$	-992

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung aus Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Morgan Stanley	-203	\$ -48.034	\$ -55
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Morgan Stanley	167	39.871	-79
3 Month SOFR Index Dezember 2025	Morgan Stanley	429	103.266	68
3 Month SOFR Index März 2024	Morgan Stanley	-68	-16.096	-19
Euro-Bund März 2024	Morgan Stanley	-86	-12.330	127
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Morgan Stanley	-25	-3.598	-2
Euro-OAT März 2024	Morgan Stanley	91	12.559	-36
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2024	Morgan Stanley	-17	-16.585	-129
Long Gilt Juni 2024	Morgan Stanley	60	7.429	-3
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	754	83.270	179
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Morgan Stanley	-475	-54.232	-216
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	125	25.594	-13
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	68	7.270	10
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	302	36.013	269
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	831	106.264	842
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.474 \$)				\$ 1.495
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.625 \$)				-552
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.151 \$)				\$ 943

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
USD	10		480		
			Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig am 15.01.2032		
	8	0,02		419	0,84
USD	10		1.120		
			Spanische Staatsanleihe, Serie 30Y, 2,700 %, fällig am 31.10.2048		
	9	0,02		930	1,87
USD	40			1.970	3,95
			Supranational – 2,07 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
USD	30		1.130		
			Europäischer Stabilitätsmechanismus, Serie EUR, 0,750 %, fällig am 05.09.2028		
	33	0,07		1.031	2,07
USD	30		Vereinigtes Königreich – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,35 %)		
			10		
			United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig am 22.07.2065		
	24	0,05	160		
USD	40		United Kingdom Inflation-Linked Gilt, Serie 3MO, 0,125 %, fällig am 22.03.2068		
				188	0,38
USD	10			196	0,39
			USA – 1,53 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
USD	20		800		
			United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig am 15.07.2033 β		
	18	0,04	60		
USD	250		United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.02.2053		
				49	0,09
	243	0,49		765	1,53
	5.231	10,50	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 27.838 €)		
			24.482		49,13
Sambia – 0,37 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
USD	200		Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,57 % (28. Februar 2023: 0,50 %)		
			845		
			Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		
	185	0,37		782	1,57
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 21.649 €)					
	20.660	41,46		782	1,57
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 49,13 % (28. Februar 2023: 51,32 %)					
Österreich – 2,32 % (28. Februar 2023: 2,40 %)					
1.340			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 52.192 €)		
			47.809		95,95
	1.157	2,32	Devisenterminkontrakte – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,05 %)		
Belgien – 2,14 % (28. Februar 2023: 2,12 %)					
1.000			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	1.064	2,14		16	0,03
Frankreich – 10,70 % (28. Februar 2023: 11,80 %)					
2.120			Futures – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,36 %)		
	1.769	3,55	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
1.030				9	0,02
	822	1,65	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
1.835			47.834		96,00
	1.836	3,69	Devisenterminkontrakte – -0,03 % (28. Februar 2023: 0,25 %)		
320			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	221	0,44		-15	-0,03
220			Futures – -0,45 % (28. Februar 2023: 0,80 %)		
	252	0,50	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	432	0,87		-224	-0,45
500			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	5.332	10,70		-239	-0,48
Deutschland – 7,42 % (28. Februar 2023: 11,53 %)					
320			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	275	0,55	47.595		95,52
2.900			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	2.757	5,53		2234	4,48
530			Gesamtvermögen		
	665	1,34	49.829 €		100,00
	3.697	7,42			
Irland – 1,07 % (28. Februar 2023: 1,03 %)					
650					
	534	1,07			
Italien – 5,95 % (28. Februar 2023: 6,17 %)					
910					
	832	1,67			
2.475					
	2.132	4,28			
	2.964	5,95			
Mexiko – 1,24 % (28. Februar 2023: 1,91 %)					
780					
	616	1,24			
Niederlande – 4,33 % (28. Februar 2023: 4,24 %)					
2.540					
	2.156	4,33			
Norwegen – 0,96 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
NOK	940				
	72	0,15			
NOK	4.960				
	405	0,81			
	477	0,96			
Polen – 1,39 % (28. Februar 2023: 1,27 %)					
PLN	3.860				
	691	1,39			
Südafrika – 1,37 % (28. Februar 2023: 1,59 %)					
USD	820				
	685	1,37			
Südkorea – 2,30 % (28. Februar 2023: 0,84 %)					
1.150					
	1.147	2,30			
Spanien – 3,95 % (28. Februar 2023: 5,75 %)					
660					
	621	1,24			

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.653.000 EUR und machten 17,37 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.

ABKÜRZUNGEN:

Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

TBA – To be announced.

GBP – Britisches Pfund Sterling

NOK – Norwegische Krone

PLN – Polnischer Zloty

USD – US-Dollar

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,71
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,54
Finanzderivate	0,05
Sonstige Vermögenswerte	5,70
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
13. Mai 2024	Citi	Kauf SEK 5.740	Verkauf EUR 507	€ 5
13. Mai 2024	Citi	Kauf EUR 115	Verkauf JPY 18.072	2
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf EUR 72	Verkauf CAD 105	1
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf EUR 154	Verkauf GBP 132	1
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf EUR 3.406	Verkauf USD 3.701	-8
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf EUR 50	Verkauf AUD 83	1
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf PLN 347	Verkauf EUR 79	1
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf NOK 327	Verkauf EUR 29	-1
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf EUR 1.390	Verkauf GBP 1.189	4
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf EUR 60	Verkauf JPY 9.534	1
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf EUR 1.958	Verkauf USD 2.128	-4
13. Mai 2024	UBS	Kauf EUR 775	Verkauf USD 842	-2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 72 €)				€ 16
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -338 €)				-15
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -266 €)				€ 1

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	33	€ 7.290	€ 3
Euro-Bobl März 2024	Bank of America Merrill Lynch	48	5.579	-63
Euro-BTP März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-3	-354	-1
Euro-Bund März 2024	Bank of America Merrill Lynch	39	5.173	-36
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-4	-533	-10
Euro-Schatz März 2024	Bank of America Merrill Lynch	75	7.886	-68
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-6	-5.416	-34
Long Gilt Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	6	687	4
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-23	-2.350	-5
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-18	-1.901	-7
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-1	-99	-
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	2	237	2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 476 €)				€ 9
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.065 €)				-224
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -589 €)				€ -215

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	
Forderungenbesicherte Wertpapiere – 1,79 % (28. Februar 2023: 0,24 %)						
782	Arbys Funding LLC, Series 2020 1A, Class A2, 144A, 3,237 %, fällig am 30.07.2050	0,30	EUR	350	Banijay Entertainment SASU, 7,000 %, fällig am 01.05.2029	
590	Home Equity Asset Trust 2005-6, Series 2005 6, Class M5, 6,380 %, fällig am 25.12.2035 *	0,23	EUR	1.000	BNP Paribas SA, 2,500 %, fällig am 31.03.2032 *	
291	Jack in the Box Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2II, 144A, 4,476 %, fällig am 25.08.2049	0,12	EUR	1.690	BNP Paribas SA, 7,375 %, Ewige Anleihe *	
480	Jack in the Box Funding LLC, Series 2022 1A, Class A2I, 144A, 3,445 %, fällig am 26.02.2052	0,18	EUR	560	Burger King France SAS, 8,647 %, fällig am 01.11.2026 *	
830	Mosaic Solar Loan Trust 2023-4, Series 2023 4A, Class C, 144A, 8,800 %, fällig am 20.05.2053	0,35	EUR	570	Goldstory SAS, 5,375 %, fällig am 01.03.2026	
1.030	ServiceMaster Funding LLC, Series 2021 1, Class A2II, 144A, 3,113 %, fällig am 30.07.2051	0,35	EUR	780	Goldstory SAS, 6,750 %, fällig am 01.02.2030	
698	SMB Private Education Loan Trust 2021-B, Series 2021 B, Class A, 144A, 1,310 %, fällig am 17.07.2051	0,26	EUR	300	IPD 3 BV, 8,000 %, fällig am 15.06.2028	
			EUR	420	Rexel SA, 5,250 %, fällig am 15.09.2030	
					7.376	3,06
Summe forderungenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 4.298 \$)						
	4.321	1,79				
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 3,90 % (28. Februar 2023: 1,81 %)						
650	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class D, 144A, 7,158 %, fällig am 15.09.2034 *	0,25	EUR	558	TK Elevator Holdco GmbH, 6,625 %, fällig am 15.07.2028	
580	BANK 2018-BNK15, Series 2018 BN15, Class B, 4,661 %, fällig am 15.11.2061 *	0,23	EUR	540	TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig am 15.05.2026	
470	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Series 2015 GC29, Class D, 144A, 3,110 %, fällig am 10.04.2048	0,16	EUR	900	ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig am 06.05.2027	
290	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust, Series 2018 COR3, Class B, 4,512 %, fällig am 10.05.2051 *	0,10			5.685	2,36
219	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 9,536 %, fällig am 25.07.2039 *	0,10	Guatemala – 0,49 % (28. Februar 2023: 1,05 %)			
260	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 8,686 %, fällig am 25.01.2040 *	0,11	1.233	1.176	0,49	
450	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 8,422 %, fällig am 25.10.2041 *	0,19	Indonesien – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,17 %)			
390	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Series 2023 R05, Class 1M2, 144A, 8,421 %, fällig am 25.06.2043 *	0,17	460	406	0,17	
800	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C3, Class C, 4,350 %, fällig am 15.08.2048 *	0,28	Irland – 0,21 % (28. Februar 2023: 0,69 %)			
710	CSAIL 2016-C7 Commercial Mortgage Trust, Series 2016 C7, Class C, 4,375 %, fällig am 15.11.2049 *	0,26	590	499	0,21	
132	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Series 2020 DNA3, Class B1, 144A, 10,536 %, fällig am 25.06.2050 *	0,06	Israel – 0,77 % (28. Februar 2023: 0,99 %)			
730	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Series 2021 DNA3, Class B1, 144A, 8,822 %, fällig am 25.10.2033 *	0,33	EUR	300	356	0,15
947	Hilton USA Trust 2016-HHV, Series 2016 HHV, Class D, 144A, 4,194 %, fällig am 05.11.2038 *	0,37	EUR	1.250	1.159	0,48
5.300	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 0,000 %, fällig am 15.06.2035 te	0,03	EUR	310	336	0,14
650	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C30, Series 2015 C30, Class AS, 4,226 %, fällig am 15.07.2048 *	0,25			1.851	0,77
802	Neighborly Issuer 2023-1, Series 2023 1A, Class A2, 144A, 7,308 %, fällig am 30.01.2053	0,34	Italien – 1,05 % (28. Februar 2023: 1,51 %)			
581	OBX 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A1, 144A, 5,928 %, fällig am 25.11.2063	0,24	EUR	500	542	0,22
205	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, Series 2017 1, Class M1, 144A, 4,000 %, fällig am 25.01.2056 *	0,09	GBP	770	982	0,41
1.390	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Class A1C3, 6,395 %, fällig am 25.12.2045 *	0,34	EUR	1.010	1.017	0,42
					2.541	1,05
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 14.925 \$)						
	9.395	3,90	Kasachstan – 1,00 % (28. Februar 2023: 1,01 %)			
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 45,46 % (28. Februar 2023: 55,37 %)						
Argentinien – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,20 %)						
500	YPF SA, 8,500 %, fällig am 28.07.2025	0,20	460	447	0,19	
Brasilien – 0,92 % (28. Februar 2023: 1,95 %)						
1.400	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig am 20.09.2031	0,51	660	538	0,22	
1.040	Suzano Austria GmbH, 5,000 %, fällig am 15.01.2030	0,41	1.520	1.422	0,59	
				2.407	1,00	
Kanada – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,99 %)						
380	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig am 01.02.2029	0,15	Luxemburg – 0,63 % (28. Februar 2023: 0,47 %)			
260	Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig am 15.02.2028	0,10	EUR	820	861	0,36
740	Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig am 15.02.2030	0,27	GBP	530	647	0,27
					1.508	0,63
China – 0,51 % (28. Februar 2023: 0,53 %)						
1.980	Prosus NV, 3,832 %, fällig am 08.02.2051	0,51	Mexiko – 1,48 % (28. Februar 2023: 1,97 %)			
Kolumbien – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,24 %)						
550	Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig am 13.01.2033	0,24	1.250	1.226	0,51	
Finnland – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,28 %)						
EUR	650	0,28	1.360	1.244	0,52	
Frankreich – 3,06 % (28. Februar 2023: 2,03 %)						
EUR	840	0,37	1.220	1.089	0,45	
530	Alice France SA/France, 144A, 8,125 %, fällig am 01.02.2027	0,20		3.559	1,48	
Niederlande – 2,04 % (28. Februar 2023: 1,90 %)						
EUR	200	0,08	EUR	200	198	0,08
EUR	800	0,32	EUR	800	780	0,32
GBP	450	0,10	GBP	450	430	0,10
GBP	1.100	0,26	GBP	1.100	1.070	0,26
GBP	1.510	0,61	GBP	1.510	1.474	0,61
550	VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig am 15.01.2032	0,20			4.912	2,04
			Peru – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,63 %)			
			610	418	0,17	
Singapur – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
EUR	139	0,06	EUR	139	143	0,06
Slowenien – 0,31 % (28. Februar 2023: 0,37 %)						
EUR	710	0,31	EUR	710	735	0,31

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert			
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)								
Südafrika – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,09 %)								
	200		680					
	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 10.04.2027	196	0,08	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig am 03.11.2036	703	0,29		
			624	Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig am 15.10.2027	623	0,26		
			246	Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig am 15.06.2028	248	0,10		
Spanien – 1,70 % (28. Februar 2023: 0,49 %)								
EUR	1.000	Banco Santander SA, 5,750 %, fällig am 23.08.2033 *	1.123	0,47	1.060	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	1.001	0,42
EUR	1.300	Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig am 15.02.2033	1.191	0,50	420	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig am 15.11.2024	397	0,17
EUR	600	Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig am 18.09.2027	637	0,26	1.160	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig am 01.07.2026	741	0,31
EUR	300	Telefonica Europe BV, 3,875 %, Ewige Anleihe *	316	0,13	670	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig am 01.12.2028	465	0,19
EUR	770	Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 5,250 %, fällig am 01.04.2026	822	0,34	830	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig am 15.06.2025	827	0,34
			4.089	1,70	380	EQT Corp, 5,000 %, fällig am 15.01.2029	371	0,15
					780	Ford Motor Credit Co LLC, 2,748 %, fällig am 14.06.2024	977	0,41
					390	Ford Motor Credit Co LLC, 3,815 %, fällig am 02.11.2027	364	0,15
					1.515	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig am 10.02.2029	1.321	0,55
					1.430	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig am 15.03.2043	1.333	0,55
					235	Goldman Sachs Capital II, 6,370 %, Ewige Anleihe *	199	0,08
					590	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, fällig am 29.10.2029 *	692	0,29
					1.400	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	1.265	0,52
					330	JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig am 22.04.2052 *	235	0,10
					440	Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, fällig am 15.02.2027	409	0,17
					930	Morgan Stanley, 3,622 %, fällig am 01.04.2031 *	845	0,35
					640	Netfix Inc, 144A, 4,875 %, fällig am 15.06.2030	635	0,26
					690	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig am 15.08.2029	628	0,26
					1.850	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig am 15.02.2030	1.721	0,71
					320	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig am 15.03.2032	321	0,13
					205	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig am 01.03.2032	233	0,10
					500	Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig am 15.09.2028	520	0,22
					1.210	Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	1.100	0,46
					700	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	507	0,21
					1.620	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig am 15.03.2032	1.958	0,81
					640	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig am 01.03.2030	634	0,26
					450	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig am 15.04.2030	418	0,17
					1.130	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.04.2029	1.043	0,43
					790	United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig am 15.05.2027	786	0,33
					1.000	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig am 15.02.2031	885	0,37
					530	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 15.02.2029	512	0,21
					1.000	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig am 15.02.2028	961	0,40
					510	Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig am 26.04.2028 *	606	0,25
					730	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig am 04.04.2051 *	676	0,28
					880	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Ewige Anleihe *	882	0,37
					210	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig am 01.06.2025	205	0,09
					480	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 15.08.2048	422	0,18
					720	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig am 01.02.2050	637	0,26
							42.577	17,67
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 116.674 \$)								
							109.525	45,46
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 37,64 % (28. Februar 2023: 26,03 %)								
Argentinien – 0,53 % (28. Februar 2023: 0,55 %)								
							1.269	0,53
Brasilien – 1,23 % (28. Februar 2023: 0,90 %)								
BRL	14.694	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig am 01.01.2027				2.953	1,23	
Kolumbien – 0,44 % (28. Februar 2023: 0,43 %)								
							1.061	0,44
Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,36 % (28. Februar 2023: 0,34 %)								
EUR	880	Internationale Staatsanleihe Ivory Coast, 5,250 %, fällig am 22.03.2030				868	0,36	
Dominikanische Republik – 0,50 % (28. Februar 2023: 0,50 %)								
							1.212	0,50
Ägypten – 0,96 % (28. Februar 2023: 0,85 %)								
							1.256	0,52
EUR	1.180	Internationale Staatsanleihe Ägypten, 6,375 %, fällig am 11.04.2031				1.052	0,44	
						2.308	0,96	
Deutschland – 0,62 % (28. Februar 2023: 0,15 %)								
EUR	650	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2029				633	0,26	
EUR	940	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2031				866	0,36	
						1499	0,62	
USA – 17,67 % (28. Februar 2023: 23,51 %)								
							164	0,07
							1.292	0,54
							573	0,24
							805	0,33
							1.300	0,54
							556	0,23
							276	0,11
							871	0,36
							113	0,05
							499	0,21
							710	0,29
							246	0,10
							966	0,40
							330	0,14
							914	0,38
							232	0,10
							1.309	0,54
							1.460	0,61
							655	0,27

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Indonesien – 1,05 % (28. Februar 2023: 2,96 %)					
IDR 39.219.000	Indonesische Staatsanleihe, Serie FR59, 7,000 %, fällig am 15.05.2027	2,541	1,05		
Jordanien – 0,16 % (28. Februar 2023: 0,17 %)					
430	Internationale Staatsanleihe Jordanien, 5,850 %, fällig am 07.07.2030	390	0,16		
Kenia – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
590	Internationale Anleihe der Republik Kenia, 9,750 %, fällig am 16.02.2031	590	0,25		
Mexiko – 3,43 % (28. Februar 2023: 3,33 %)					
MXN 69.240	Mexikanische Bonos, Series M, 8,500 %, fällig am 31.05.2029	3.960	1,64		
MXN 84.947	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	4.310	1,79		
		8.270	3,43		
Nigeria – 0,45 % (28. Februar 2023: 0,42 %)					
1.400	Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 7,625 %, fällig am 28.11.2047	1.083	0,45		
Oman – 0,16 % (28. Februar 2023: 0,17 %)					
390	Internationale Staatsanleihe Oman, 6,000 %, fällig am 01.08.2029	396	0,16		
Polen – 1,74 % (28. Februar 2023: 1,46 %)					
PLN 21.700	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig am 25.04.2032	4.200	1,74		
Südafrika – 1,51 % (28. Februar 2023: 1,46 %)					
ZAR 90.478	Staatsanleihe Republik Südafrika, Series R214, 6,500 %, fällig am 28.02.2041	2.804	1,17		
1.130	Internationale Staatsanleihe der Republik Südafrika, 5,750 %, fällig am 30.09.2049	825	0,34		
		3.629	1,51		
USA – 24,25 % (28. Februar 2023: 11,09 %)					
6.240	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 30.04.2024	6.206	2,58		
12.270	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	11.916	4,95		
4.310	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig am 15.11.2026	4.043	1,68		
2.250	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig am 31.03.2027	2.008	0,83		
11.820	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 31.10.2027	11.725	4,87		
500	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 31.03.2028	487	0,20		
30	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.08.2030	24	0,01		
5.680	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.11.2031	4.612	1,91		
290	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig am 15.08.2032	259	0,11		
3.320	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032	3.286	1,36		
120	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15.08.2041	80	0,03		
140	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2041	97	0,04		
600	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig am 15.08.2042	513	0,21		
2.320	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig am 15.11.2042	2.166	0,90		
1.696	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig am 15.08.2043	1.661	0,69		
1.650	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.05.2045 =	1.305	0,54		
15	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.11.2045	12	–		
500	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2046	340	0,14		
360	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2047	281	0,12		
7.240	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 15.05.2048	5.755	2,39		
820	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.02.2049	636	0,26		
430	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	325	0,14		
40	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	20	0,01		
200	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	105	0,04		
270	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	209	0,09		
410	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	359	0,15		
		58.430	24,25		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 99.919 \$)					
		90.699	37,64		
Schuldscheindarlehen – 2,09 % (28. Februar 2023: 3,84 %)					
576	Alterra Mountain Co, 8,947 %, fällig am 30.07.2028 *	578	0,24		
571	API Group De Inc, 7,701 %, fällig am 01.10.2026 *	571	0,24		
670	Asurion LLC, 9,683 %, fällig am 19.08.2028 *	668	0,28		
622	Focus Financial Partners LLC, 8,083 %, fällig am 30.06.2028 *	619	0,25		
268	Fugue Finance LLC, 9,388 %, fällig am 26.01.2028 *	269	0,11		
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 5.038 \$)					
		5.033	2,09		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,30 % (28. Februar 2023: 1,77 %)					
22	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ Accumulating	3.139	1,30		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.474 \$)					
		3.139	1,30		
Stammaktien – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,18 %)					
Schweiz – 0,09 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
1.760	Credit Suisse Group AG Escrow †=	216	0,09		
USA – 0,13 % (28. Februar 2023: 0,18 %)					
44	Berry Corp	309	0,13		
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 491 \$)					
		525	0,22		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 243.819 \$)					
		222.637	92,40		
Devisenterminkontrakte – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,34 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				364	0,15
Futures – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,03 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				43	0,02
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
		223.044	92,57		
Devisenterminkontrakte – 0,65 % (28. Februar 2023: 1,76 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				-1.576	-0,65
Futures – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,01 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				-139	-0,06
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
		-1.715	-0,71		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
		221.329	91,86		
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte					
		19.611	8,14		
Gesamtvermögen					
		240.940 \$	100,00		
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A	Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 30.641.000 USD und machten 12,69 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.				
†	Nicht liquide.				
∞	Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.				
ε	Das Wertpapier ist zum 29. Februar 2024 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).				
≠	Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 29. Februar 2024 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.				
ABKÜRZUNGEN:					
Ewige Anleihe	– Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.				
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit				
BRL	– Brasilianischer Real				
EUR	– Euro				
GBP	– Britisches Pfund Sterling				
IDR	– Indonesische Rupiah				
INR	– Indische Rupie				
MXN	– Mexikanischer Peso				
PLN	– Polnischer Zloty				
ZAR	– Südafrikanischer Rand				
Verteilung des Gesamtvermögens					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				88,02	% des Gesamtvermögens
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				2,07	
Organismen für gemeinsame Anlagen				1,29	
Finanzderivate				0,17	
Sonstige Vermögenswerte				8,45	
Gesamtvermögen				100,00	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2024	Morgan Stanley	Kauf	USD	3.189	Verkauf	TWD	99.169	46
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	707	Verkauf	CHF	625	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	60	Verkauf	EUR	54	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	EUR	10	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	13	Verkauf	GBP	11	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	36	Verkauf	GBP	29	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	34	Verkauf	PLN	140	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	SGD	4	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	ZAR	125.978	Verkauf	USD	6.649	-91
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	96.038	Verkauf	USD	62.627	-171
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	4.174	Verkauf	USD	4.490	22
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CHF	53.081	Verkauf	USD	61.215	-1.092
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.253	Verkauf	USD	934	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	1	Verkauf	USD	1	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	981	Verkauf	USD	1.234	4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	PLN	10.832	Verkauf	USD	2.676	36
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	ZAR	24.697	Verkauf	USD	1.278	8
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	47	Verkauf	USD	51	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	78	Verkauf	ZAR	1.483	-
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf	USD	120	Verkauf	EUR	111	-
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf	USD	1.896	Verkauf	PLN	7.583	-2
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf	JPY	965.332	Verkauf	USD	6.684	-168
13. Mai 2024	Citi	Kauf	USD	442	Verkauf	EUR	409	-1
13. Mai 2024	Citi	Kauf	USD	8.144	Verkauf	GBP	6.381	87
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD	5.908	Verkauf	EUR	5.445	4
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.810	Verkauf	GBP	1.418	19
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD	218	Verkauf	MXN	3.806	-3
13. Mai 2024	HSBC	Kauf	USD	20.759	Verkauf	EUR	19.127	22
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf	USD	214	Verkauf	EUR	197	-
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf	USD	3.247	Verkauf	GBP	2.544	35
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf	ZAR	5.000	Verkauf	USD	265	-6
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf	AUD	3.230	Verkauf	USD	2.135	-30
13. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf	CAD	1.230	Verkauf	USD	917	-9
13. Mai 2024	UBS	Kauf	USD	7.501	Verkauf	GBP	5.876	81
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 775 \$)							\$	364
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -4.011 \$)								-1.576
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.236 \$)							\$	-1.212

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-5	\$ -628	\$ 7
Euro-Bund März 2024	Bank of America Merrill Lynch	89	12.760	-89
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-1	-144	-3
Long Gilt Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	44	5.448	36
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-39	-4.307	-8
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	12	2.457	-2
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-23	-2.743	-11
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-30	-3.836	-26
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 74 \$)				\$ 43
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -29 \$)				-139
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 45 \$)				\$ -96

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 5,29 % (28. Februar 2023: 6,50 %)			Luxemburg – 1,04 % (28. Februar 2023: 1,51 %)		
500 522 Funding CLO 2018-3A Ltd, Series 2018 3A, Class DR, 144A, 8,679 %, fällig am 20.10.2031 *	501	0,52	500 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig am 15.08.2029	431	0,44
250 AB BSL CLO 2 Ltd, Series 2021 2A, Class D, 144A, 8,926 %, fällig am 15.04.2034 *	248	0,26	710 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig am 15.05.2027	465	0,48
310 AGL CLO 6 Ltd, Series 2020 6A, Class ER, 144A, 12,079 %, fällig am 20.07.2034 *	312	0,32	260 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig am 30.06.2027	111	0,12
300 Apex Credit CLO 2022-1 Ltd, Series 2022 1A, Class D, 144A, 9,718 %, fällig am 22.04.2033 *	297	0,31		1.007	1,04
440 Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 8,729 %, fällig am 20.04.2031 *	440	0,45	Macau – 0,69 % (28. Februar 2023: 1,80 %)		
420 Canyon CLO 2020-1 Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 11,926 %, fällig am 15.07.2034 *	411	0,43	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2026	194	0,20
300 GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Series 2014 9A, Class DR2, 144A, 8,581 %, fällig am 29.10.2029 *	300	0,31	510 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 26.08.2028	480	0,49
250 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 10,526 %, fällig am 15.04.2031 *	236	0,24		674	0,69
510 Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class E, 144A, 11,279 %, fällig am 20.01.2030 *	508	0,52	Niederlande – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,30 %)		
443 Magnette XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 11,256 %, fällig am 15.10.2031 *	431	0,44	420 Sunrise HoldCo IV BV, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2028	407	0,42
250 Neuberger Berman CLO XVIII Ltd, Series 2014 18A, Class DR2, 144A, 11,499 %, fällig am 21.10.2030 *	249	0,26	Polen – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,36 %)		
250 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 28 Ltd, Series 2018 28A, Class D, 144A, 8,429 %, fällig am 20.04.2030 *	249	0,26	370 Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 15.11.2029	321	0,33
300 Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144A, 9,026 %, fällig am 13.10.2031 *	283	0,29	Spanien – 0,44 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
200 Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class D, 144A, 11,138 %, fällig am 20.01.2035 *	200	0,21	400 Banco Santander SA, 9,625 %, Ewige Anleihe *	429	0,44
280 Trinitas CLO X Ltd, Series 2019 10A, Class DR, 144A, 8,917 %, fällig am 15.01.2035 *	265	0,27	Schweden – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
190 Warwick Capital CLO 1 Ltd, Series 2023 1A, Class D, 144A, 11,012 %, fällig am 20.10.2036 *	193	0,20	230 Stena International SA, 144A, 7,250 %, fällig am 15.01.2031	229	0,24
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 5.111 \$)	5.123	5,29	Schweiz – 1,45 % (28. Februar 2023: 2,04 %)		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 85,85 % (28. Februar 2023: 84,70 %)			Vereinigte Arabische Emirate – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Bermuda – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,65 %)			380 Shelf Drilling Holdings Ltd, 144A, 9,625 %, fällig am 15.04.2029		
371 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig am 15.10.2025	371	0,38		367	0,38
Kanada – 3,12 % (28. Februar 2023: 2,47 %)			Vereinigtes Königreich – 3,49 % (28. Februar 2023: 2,54 %)		
250 Bank of Nova Scotia/The, 8,000 %, fällig am 27.01.2084 *	253	0,26	1.280 Barclays Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	1.280	1,32
230 Bombardier Inc, 144A, 8,750 %, fällig am 15.11.2030	241	0,25	330 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,750 %, fällig am 15.01.2032	314	0,32
300 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig am 15.01.2028	290	0,30	800 HSBC Holdings Plc, 4,600 %, Ewige Anleihe *	665	0,69
350 Empire Communities Corp, 144A, 7,000 %, fällig am 15.12.2025	346	0,36	740 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	730	0,76
420 GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.06.2029	394	0,41	450 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031	390	0,40
850 Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, fällig am 01.04.2029	835	0,86		3.379	3,49
330 Open Text Corp, 144A, 6,900 %, fällig am 01.12.2027	341	0,35	USA – 65,40 % (28. Februar 2023: 67,88 %)		
310 Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, fällig am 31.10.2082 *	324	0,33	280 AAR Escrow Issuer LLC, 144A, 6,750 %, fällig am 15.03.2029	283	0,29
	3.024	3,12	340 Academy Ltd, 144A, 6,000 %, fällig am 15.11.2027	337	0,35
Cayman Islands – 0,73 % (28. Februar 2023: 0,91 %)			742 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig am 01.03.2028	768	0,79
739 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	703	0,73	220 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.03.2028	210	0,22
Frankreich – 2,65 % (28. Februar 2023: 0,28 %)			470 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig am 15.06.2030	470	0,49
240 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2028	196	0,20	500 Akumin Inc, 144A, 9,000 %, fällig am 01.08.2027	408	0,42
670 Altice France SA/France, 144A, 5,125 %, fällig am 15.07.2029	507	0,52	1.130 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig am 15.02.2028	567	0,59
210 BNP Paribas SA, 144A, 8,000 %, Ewige Anleihe *	210	0,22	370 Alta Equipment Group Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.04.2026	359	0,37
810 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	818	0,84	910 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 15.02.2029	630	0,65
820 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Ewige Anleihe *	838	0,87	310 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig am 15.02.2028	313	0,32
	2.569	2,65	720 American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 15.05.2029	757	0,78
Deutschland – 0,70 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			470 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.04.2029	460	0,48
650 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 14.04.2030	678	0,70	450 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig am 01.10.2029	391	0,40
Hongkong – 0,23 % (28. Februar 2023: 0,45 %)			515 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig am 01.09.2026	573	0,59
250 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig am 04.12.2029	225	0,23	95 Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc, 144A, 10,000 %, fällig am 15.08.2026 €	2	–
Indien – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,25 %)			800 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.06.2029	663	0,68
340 CA Magnum Holdings, 144A, 5,375 %, fällig am 31.10.2026	328	0,34	400 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig am 01.09.2029	325	0,34
Israel – 1,23 % (28. Februar 2023: 1,26 %)			160 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 15.02.2030	143	0,15
500 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig am 01.02.2036	478	0,49	470 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 01.10.2030	473	0,49
660 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig am 15.09.2031	714	0,74	110 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig am 01.02.2027	71	0,07
	1.192	1,23	690 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 15.02.2029	317	0,33
Italien – 1,81 % (28. Februar 2023: 0,70 %)			400 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 30.01.2030	173	0,18
700 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig am 15.01.2026	694	0,72	170 Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 01.08.2030	171	0,18
480 Telecom Italia Capital SA, 6,000 %, fällig am 30.09.2034	446	0,46	450 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	441	0,46
660 UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig am 30.06.2035 *	610	0,63			
	1.750	1,81			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
500 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig am 15.07.2026	497	0,51	150 iHeartCommunications Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	111	0,12
170 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.05.2029	156	0,16	230 iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.01.2028	166	0,17
330 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2030	317	0,33	490 IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, fällig am 25.05.2026	463	0,48
350 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig am 01.07.2031	368	0,38	210 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 15.11.2029	193	0,20
1.010 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2030	1.036	1,07	260 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig am 15.12.2031	267	0,28
260 Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 15.02.2032	262	0,27	390 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig am 15.06.2029	350	0,36
400 Cano Health LLC, 144A, 6,250 %, fällig am 01.10.2028	6	0,01	610 LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, fällig am 15.08.2030	634	0,65
100 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig am 01.03.2027	99	0,10	230 LifePoint Health Inc, 144A, 11,000 %, fällig am 15.10.2030	244	0,25
1.310 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig am 01.06.2030	1.430	1,48	300 LSF11 AS HoldCo LLC, 144A, 6,625 %, fällig am 15.10.2029	261	0,27
500 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig am 15.10.2029	433	0,45	130 Madison IAQ LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 30.06.2028	119	0,12
1.190 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	961	0,99	600 Madison IAQ LLC, 144A, 5,875 %, fällig am 30.06.2029	536	0,55
290 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	229	0,24	430 Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.10.2031	363	0,37
800 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp., 144A, 4,500 %, fällig am 01.06.2033	616	0,64	700 Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig am 01.10.2029	648	0,67
220 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig am 15.06.2029	222	0,23	480 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig am 01.05.2028	373	0,39
390 Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Ewige Anleihe *	322	0,33	280 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, fällig am 01.05.2028	257	0,27
260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, fällig am 01.04.2051	158	0,16	420 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,625 %, fällig am 15.01.2030	356	0,37
600 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 01.06.2026	601	0,62	230 MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp, 144A, 5,500 %, fällig am 01.02.2030	210	0,22
210 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2029	134	0,14	200 Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, fällig am 01.02.2026	189	0,19
140 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig am 01.04.2030	88	0,09	70 Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250 %, fällig am 15.12.2027	76	0,08
860 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.05.2030	687	0,71	340 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig am 15.03.2031	228	0,24
300 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig am 15.01.2032	306	0,32	500 Nabors Industries Ltd, 144A, 7,250 %, fällig am 15.01.2026	493	0,51
270 Citigroup Inc, Series BB, 7,200 %, Ewige Anleihe *	271	0,28	200 NCL Corp Ltd, 144A, 8,375 %, fällig am 01.02.2028	210	0,22
165 Clean Harbors Inc, 144A, 6,375 %, fällig am 01.02.2031	164	0,17	900 NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, fällig am 15.01.2029	948	0,98
410 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 01.06.2029	340	0,35	320 NCL Corp Ltd, 144A, 7,750 %, fällig am 15.02.2029	328	0,34
360 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig am 01.10.2031	282	0,29	500 NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2028	488	0,50
700 Commscope Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.09.2029	480	0,50	350 NCR Atleos Corp, 144A, 9,500 %, fällig am 01.04.2029	371	0,38
130 Commscope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, fällig am 15.03.2027	47	0,05	140 NextEra Energy Partners LP, 144A, 2,500 %, fällig am 15.06.2026	127	0,13
290 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig am 15.02.2028	304	0,31	400 Northern Oil & Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig am 01.03.2028	405	0,42
270 CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, fällig am 15.05.2028	279	0,29	760 Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 01.11.2022	-	-
330 CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, fällig am 31.01.2029	345	0,36	510 Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 01.04.2027	324	0,33
810 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig am 01.02.2029	707	0,73	600 Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, fällig am 15.04.2027	550	0,57
320 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig am 15.01.2030	188	0,19	70 Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, fällig am 15.06.2029	63	0,06
250 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 01.12.2030	186	0,19	170 Permian Resources Operating LLC, 144A, 8,000 %, fällig am 15.04.2027	175	0,18
430 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig am 15.11.2031	235	0,24	290 Permian Resources Operating LLC, 144A, 9,875 %, fällig am 15.07.2031	321	0,33
490 Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, fällig am 01.09.2031	511	0,53	410 Permian Resources Operating LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.01.2032	421	0,43
230 Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2030	227	0,23	250 PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750 %, fällig am 15.02.2029	247	0,26
650 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	614	0,63	800 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig am 01.10.2028	809	0,84
920 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig am 01.07.2026	587	0,61	760 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 15.01.2028	750	0,77
630 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig am 01.12.2028	437	0,45	340 Rackspace Technology Global Inc, 3,500 %, fällig am 31.05.2028	204	0,21
1.010 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig am 01.06.2029	432	0,45	400 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig am 15.01.2029	418	0,43
90 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig am 15.06.2025	90	0,09	290 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig am 15.02.2030	270	0,28
170 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig am 15.02.2028	135	0,14	1.100 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, fällig am 15.10.2033	914	0,94
440 Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 15.10.2029	396	0,41	430 Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, fällig am 15.03.2028	397	0,41
270 DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig am 15.03.2028	230	0,24	630 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig am 15.03.2032	632	0,65
400 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig am 15.07.2029	360	0,37	220 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,750 %, fällig am 31.07.2028	225	0,23
150 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 09.01.2028	139	0,14	160 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, fällig am 01.03.2032	160	0,16
250 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 01.01.2030	237	0,24	2 Service Corp International/US, 7,500 %, fällig am 01.04.2027	2	-
190 FirstCash Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 03.01.2032	188	0,19	270 Service Corp International/US, 4,000 %, fällig am 15.05.2031	237	0,25
311 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 10,500 %, fällig am 15.01.2028	318	0,33	400 Service Properties Trust, 144A, 8,625 %, fällig am 15.11.2031	423	0,44
1.090 Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig am 01.10.2029	924	0,95	560 SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, fällig am 15.12.2028	556	0,57
330 Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, fällig am 06.03.2030	350	0,36	360 Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig am 28.11.2025	361	0,37
700 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig am 13.11.2030	619	0,64	340 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, fällig am 01.11.2028	330	0,34
430 Freepoint-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig am 15.03.2043	401	0,41	280 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, fällig am 15.11.2031	297	0,31
570 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig am 15.02.2028	535	0,55	330 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	300	0,31
510 Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, fällig am 01.11.2026	461	0,48	100 Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig am 01.11.2027	95	0,10
370 Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 30.09.2030	378	0,39			
510 Gray Television Inc, 144A, 5,375 %, fällig am 15.11.2031	330	0,34			
550 GTCR W-2 Merger Sub LLC, 144A, 7,500 %, fällig am 15.01.2031	574	0,59			
430 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	388	0,40			
207 HCA Inc, 7,500 %, fällig am 15.11.2095	221	0,23			
360 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, fällig am 15.04.2032	349	0,36			
150 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 8,375 %, fällig am 01.11.2033	161	0,17			
100 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, fällig am 15.01.2027	100	0,10			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
380 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	275	0,28	47 MRI Software LLC, 10,948 %, fällig am 10.02.2026 *	47	0,05
150 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	109	0,11	159 Neptune Bidco U.S. Inc, 10,423 %, fällig am 11.04.2029 *	146	0,15
360 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig am 15.03.2032	435	0,45	458 Phoenix Guarantor Inc, 0,000 %, fällig am 13.02.2031 *	454	0,47
200 StoneX Group Inc, 144A, 7,875 %, fällig am 01.03.2031	203	0,21	386 R.R. Donnelley, 12,683 %, fällig am 08.03.2028 *	389	0,40
870 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig am 01.09.2026	708	0,73	183 Redstone Holdco 2 LP, 10,201 %, fällig am 27.04.2028 *	153	0,16
200 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 31.12.2030	186	0,19	657 Rent-A-Center Inc/TX, 9,119 %, fällig am 17.02.2028 *	657	0,68
280 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	278	0,29	400 Spencer Spirit IH LLC, 11,430 %, fällig am 14.06.2026 *	399	0,41
200 TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, fällig am 15.03.2029	179	0,19	120 United Airlines Inc, 8,076 %, fällig am 17.02.2031 *	120	0,12
500 TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig am 15.08.2028	507	0,52	390 Verscend Holding Corp., 9,447 %, fällig am 27.08.2025 *	391	0,40
200 TransDigm Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 01.12.2031	205	0,21	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 6.494 \$)	6.209	6,41
320 Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 01.04.2029	280	0,29	Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,60 % (28. Februar 2023: 1,33 %)		
150 Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, fällig am 01.05.2025	148	0,15	577 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	577	0,60
720 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.04.2029	665	0,69	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 577 \$)	577	0,60
770 United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig am 15.01.2030	746	0,77	Stammaktien – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
240 Univision Communications Inc, 144A, 8,000 %, fällig am 15.08.2028	241	0,25	Schweiz – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
370 Urban One Inc, 144A, 7,375 %, fällig am 01.02.2028	318	0,33	2.640 Credit Suisse Group AG Escrow †∞	323	0,33
219 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig am 28.06.2028	185	0,19	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)	323	0,33
530 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, fällig am 15.01.2030	530	0,55	Vorzugsaktien – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,51 %)		
180 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 15.08.2031	158	0,16	USA – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,51 %)		
120 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 01.11.2033	101	0,10	9 MPLX LP, Series A ∞	333	0,34
680 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, fällig am 01.02.2032	716	0,74	Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 286 \$)	333	0,34
850 Vericast Corp, 144A, 11,000 %, fällig am 15.09.2026	895	0,92	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 101.468 \$)		
120 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig am 15.09.2027	117	0,12	Credit Default Swaps 0,43 % (28. Februar 2023: 0,08 %)	96.006	99,10
450 Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2029	450	0,46	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	421	0,43
260 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig am 15.07.2031	282	0,29	Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
120 Vistra Operations Co LLC, 144A, 7,750 %, fällig am 15.10.2031	124	0,13	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	14	0,01
800 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 15.04.2029	372	0,38	Futures – 0,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
840 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig am 15.02.2031	868	0,90	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	8	0,01
690 XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig am 01.05.2034	715	0,74	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
320 XPO Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 01.02.2032	326	0,34	Credit Default Swaps – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,09 %)	96.449	99,55
440 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 15.01.2030	388	0,40	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-219	-0,22
	63.358	65,40	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,03 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1	-
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
				-220	-0,22
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
				96.229	99,33
			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
				649	0,67
			Gesamtnettovermögen		
				96.878 \$	100,00
Sambia – 0,78 % (28. Februar 2023: 1,27 %)					
730 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig am 01.03.2029	757	0,78	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 89.342 \$)					
	83.169	85,85	144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 73.653.000 USD und machten 76,02 % des Nettovermögens aus.		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,22 %)					
Argentinien – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,22 %)					
640 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,375 %, fällig am 01.09.2037	249	0,26	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.		
60 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 6,375 %, fällig am 01.09.2037	23	0,02	† Nicht liquide.		
	272	0,28	∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 272 \$)					
	272	0,28	ε Das Wertpapier ist zum 29. Februar 2024 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).		
Schuldscheindarlehen – 6,41 % (28. Februar 2023: 5,28 %)					
177 19th Holdings Golf, LLC, 8,674 %, fällig am 07.02.2029 *	173	0,18	ABKÜRZUNGEN:		
271 Adtalem Global Education, 8,837 %, fällig am 14.08.2028 *	272	0,28	Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.		
425 Asurion LLC, 9,433 %, fällig am 17.08.2028 *	422	0,44			
249 Clarios Global LP, 8,333 %, fällig am 06.05.2030 *	250	0,26			
190 Cotiviti Inc, 0,000 %, fällig am 24.02.2031 *	190	0,20			
570 DCert Buyer, Inc., 12,333 %, fällig am 16.02.2029 *	522	0,54			
190 Deerfield Dakota Holding LLC, 12,360 %, fällig am 14.04.2028 *	189	0,20			
338 Equinox Holdings Inc, 14,610 %, fällig am 08.03.2024 *	335	0,35			
366 Eyecare Partners LLC, 9,324 %, fällig am 05.02.2027 *†	199	0,20			
491 Focus Financial Partners LLC, 8,083 %, fällig am 30.06.2028 *	489	0,50			
230 Global TelLink Corp, 9,748 %, fällig am 29.11.2025 *	224	0,23			
177 Magenta Buyer LLC, 10,574 %, fällig am 03.05.2028 *	107	0,11			
82 MRI Software LLC, 10,948 %, fällig am 10.02.2026 *	81	0,08			
			Verteilung des Gesamtvermögens		
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
			88,94		
			Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		
			6,19		
			Organismen für gemeinsame Anlagen		
			0,58		
			Finanzderivate		
			0,44		
			Sonstige Vermögenswerte		
			3,85		
			Gesamtvermögen		
			100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	American Axle & Manufacturing, Inc, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	580	\$ 25
Goldman Sachs	CDX.HY.CDSI 5 Year, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	960	60
Goldman Sachs	Delta Airlines Inc, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	668	97
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	230	34
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2026	900	98
Goldman Sachs	General Motors Co, 5,000 % – Kauf	20. Dez. 2028	230	-37
Goldman Sachs	Macy's, Inc, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2028	420	39
Goldman Sachs	Nabors Industries, Inc, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	419	-77
Goldman Sachs	Nordstrom Inc, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	420	-43
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 % – Verkauf	20. Juni 2026	700	8
Goldman Sachs	Southwest Airlines Co, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2028	668	-9
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % – Kauf	20. Juni 2027	580	-53
Goldman Sachs	Transocean Inc, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2028	419	60
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 102 \$)				\$ 421
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -116 \$)				-219
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -14 \$)				\$ 202

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 729	Verkauf GBP 576	\$ 2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 32	Verkauf SGD 43	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 29	Verkauf SGD 39	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD 45	Verkauf USD 32	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD 822	Verkauf USD 613	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 588	Verkauf USD 740	3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1.640	Verkauf USD 1.766	9
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf USD –	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 19	Verkauf USD 20	–
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 6	Verkauf CAD 8	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1 \$)				\$ 14
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -35 \$)				-1
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -34 \$)				\$ 13

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Goldman Sachs	76	\$ 8.125
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)			\$ 8
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -31 \$)			–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -31 \$)			\$ 8

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert				
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,50 % (28. Februar 2023: 0,40 %)			Mexiko – 1,88 % (28. Februar 2023: 1,56 %)						
250	Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 11,256 %, fällig am 15.10.2031 *	243	0,50	200	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, Ewige Anleihe *	196	0,40		
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 247 \$)			Peru – 1,21 % (28. Februar 2023: 1,00 %)						
243		0,50	750	Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, fällig am 19.06.2032	589	1,21			
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 77,42 % (28. Februar 2023: 73,14 %)			Polen – 0,54 % (28. Februar 2023: 0,42 %)						
Brasilien – 1,93 % (28. Februar 2023: 1,86 %)			300	Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 15.11.2029	261	0,54			
450	B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig am 20.09.2031	393	0,81	Slowenien – 0,43 % (28. Februar 2023: 0,28 %)					
650	MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig am 14.01.2031	545	1,12	EUR	200	United Group BV, 5,250 %, fällig am 01.02.2030	207	0,43	
		938	1,93	Schweden – 2,12 % (28. Februar 2023: 1,47 %)					
Kanada – 2,30 % (28. Februar 2023: 0,50 %)			200	Asseblin Group AB, 8,929 %, fällig am 05.07.2029 *	111	0,23			
340	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig am 15.02.2029	307	0,64	EUR	200	Heimstaden AB, 4,250 %, fällig am 09.03.2026	121	0,25	
150	Bombardier Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 15.06.2026	152	0,31	EUR	300	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,375 %, fällig am 04.09.2026	253	0,52	
400	GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 01.06.2025	393	0,81	230	Stena International SA, 144A, 7,250 %, fällig am 15.01.2031	229	0,47		
250	Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750 %, fällig am 15.03.2031	263	0,54	EUR	280	Verisure Holding AB, 7,125 %, fällig am 01.02.2028	316	0,65	
		1.115	2,30			1.030	2,12		
Cayman Islands – 1,30 % (28. Februar 2023: 1,78 %)			Schweiz – 0,26 % (28. Februar 2023: 2,38 %)						
661	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	629	1,30	150	Vistalet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 8,775 %, fällig am 01.05.2027	127	0,26		
China – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,28 %)			Türkei – 1,23 % (28. Februar 2023: 1,19 %)						
400	China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, fällig am 08.02.2025 €	9	0,02	200	Coca-Cola Icecek AS, 144A, 4,500 %, fällig am 20.01.2029	187	0,39		
400	China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, fällig am 23.01.2025 €	8	0,02	410	Türk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig am 28.02.2025	410	0,84		
		17	0,04			597	1,23		
Kolumbien – 0,89 % (28. Februar 2023: 0,44 %)			Vereinigtes Königreich – 7,09 % (28. Februar 2023: 5,97 %)						
280	Ecopetrol SA, 8,375 %, fällig am 19.01.2036	282	0,58	EUR	220	888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, fällig am 15.07.2027	232	0,48	
200	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig am 28.05.2045	148	0,31	EUR	200	888 Acquisitions Ltd, 144A, 7,558 %, fällig am 15.07.2027	211	0,44	
		430	0,89	200	Ashtead Capital Inc, 144A, 2,450 %, fällig am 12.08.2031	161	0,33		
Frankreich – 1,06 % (28. Februar 2023: 0,93 %)			200	Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, fällig am 16.02.2026	269	0,55			
220	Altice France SA.France, 144A, 5,500 %, fällig am 15.10.2029	167	0,34	100	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig am 07.04.2026	122	0,25		
210	Banjay Entertainment SASU, 144A, 8,125 %, fällig am 01.05.2029	217	0,45	280	Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	276	0,57		
EUR	120	Burger King France SAS, 8,647 %, fällig am 01.11.2026 *	131	0,27	GBP	100	Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig am 19.05.2026	121	0,25
		515	1,06	510	Marston's Issuer Plc, Series B1, 7,890 %, fällig am 16.07.2035 *	486	1,00		
Deutschland – 3,64 % (28. Februar 2023: 2,00 %)			140	Saga Plc, 5,500 %, fällig am 15.07.2026	158	0,33			
EUR	450	APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig am 15.01.2027	477	0,98	400	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig am 15.05.2029	375	0,77	
EUR	360	APCOA Parking Holdings GmbH, 144A, 4,625 %, fällig am 15.01.2027	381	0,79	560	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031	485	1,00	
EUR	240	TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig am 15.05.2026	261	0,54	400	Vodafone Group Plc, 4,125 %, fällig am 30.05.2025	394	0,81	
			439	0,90	GBP	140	Wheel Bidco Ltd, 144A, 6,750 %, fällig am 15.07.2026	151	0,31
		209	0,43			3.441	7,09		
		1.767	3,64	USA – 39,38 % (28. Februar 2023: 36,14 %)					
Guatemala – 1,78 % (28. Februar 2023: 1,14 %)			200	Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig am 01.05.2028	179	0,37			
690	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Belu Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig am 27.04.2029 *	648	1,33	550	American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, fällig am 01.03.2025	538	1,11		
250	Millicom International Cellular SA, 4,500 %, fällig am 27.04.2031	216	0,45	150	American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig am 15.02.2028	151	0,31		
		864	1,78	100	American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 15.05.2029	105	0,22		
Hongkong – 0,48 % (28. Februar 2023: 0,67 %)			260	Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig am 04.12.2029	234	0,48			
Irland – 0,57 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Irland – 0,57 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
330	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, fällig 29.10.2033	274	0,57	280	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2027	275	0,57		
Israel – 2,77 % (28. Februar 2023: 3,90 %)			200	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	145	0,30			
1.450	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig am 01.10.2026	1.345	2,77	390	Ball Corp, 2,875 %, fällig am 15.08.2030	331	0,68		
Italien – 2,25 % (28. Februar 2023: 1,71 %)			250	Ball Corp, 3,125 %, fällig am 15.09.2031	211	0,43			
720	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig am 01.06.2032 *	591	1,22	80	Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 01.08.2030	81	0,17		
70	Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, fällig am 18.07.2036	69	0,14	340	Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig am 01.07.2030	314	0,65		
430	Telecom Italia SpA.Milano, 144A, 5,303 %, fällig am 30.05.2024	429	0,89	210	Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2030	215	0,44		
		1.089	2,25	90	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 15.02.2032	91	0,19		
Luxemburg – 3,07 % (28. Februar 2023: 3,83 %)			230	Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, fällig am 01.05.2028	251	0,52			
830	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig am 15.08.2029	716	1,48	EUR	500	Carnival Plc, 1,000 %, fällig am 28.10.2029	423	0,87	
200	Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig am 15.05.2027	131	0,27	110	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 15.05.2029	96	0,20		
410	Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig am 15.02.2028	207	0,43	600	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	449	0,93		
390	ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig am 30.06.2027	167	0,34	150	Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Ewige Anleihe *	124	0,25		
GBP	220	Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig am 01.04.2028	269	0,55	190	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig am 15.01.2032	194	0,40	
		1.490	3,07	270	Comerica Bank, 2,500 %, fällig am 23.07.2024	266	0,55		
Macau – 0,73 % (28. Februar 2023: 1,90 %)			380	CSC Holdings LLC, 144A, 4,625 %, fällig am 01.12.2030	212	0,44			
210	Sands China Ltd, 3,250 %, fällig am 08.08.2031	175	0,36	250	CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig am 15.02.2031	177	0,36		
200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig am 15.12.2029	181	0,37						
		356	0,73						

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Argentinien – 2,76 % (28. Februar 2023: 2,30 %)		
USA – (Fortsetzung)			161 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig am 09.07.2029 75 0,16		
200 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig am 15.11.2031	149	0,31	297 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,750 %, fällig am 09.07.2030	136	0,28
870 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig am 15.11.2031	475	0,98	944 Internationale Staatsanleihe der Republik Argentinien, 3,625 %, fällig am 09.07.2035	352	0,73
60 Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, fällig am 01.09.2031	63	0,13	1.271 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,375 %, fällig am 01.09.2037	494	1,02
200 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig am 28.10.2024	196	0,40	340 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig am 01.06.2027	279	0,57
200 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	189	0,39		1.336	2,76
230 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig am 15.11.2024	218	0,45	Bahrain – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,43 %)		
510 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig am 01.06.2029	218	0,45	310 Internationale Staatsanleihe Bahrain, 144A, 6,000 %, fällig am 19.09.2044 251 0,52		
300 DISH Network Corp, 2,375 %, fällig am 15.03.2024	296	0,61	Kolumbien – 0,57 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
720 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig am 15.08.2026	429	0,88	350 Internationale Staatsanleihe Kolumbien, 3,125 %, fällig am 15.04.2031 277 0,57		
100 Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, fällig am 01.03.2031	76	0,16	Costa Rica – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,34 %)		
1.080 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	886	1,83	200 Internationale Anleihe der Regierung von Costa Rica, 6,125 %, fällig am 19.02.2031 203 0,42		
180 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig am 15.02.2028	169	0,35	Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,74 % (28. Februar 2023: 0,62 %)		
200 GTCR W-2 Merger Sub LLC, 144A, 7,500 %, fällig am 15.01.2031	209	0,43	410 Internationale Staatsanleihe Ivory Coast, 144A, 6,125 %, fällig am 15.06.2033 360 0,74		
830 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	750	1,55	Dominikanische Republik – 1,97 % (28. Februar 2023: 1,60 %)		
140 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 8,375 %, fällig am 01.11.2033	150	0,31	380 Internationale Staatsanleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 4,500 %, fällig am 30.01.2030 346 0,71		
500 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig am 01.05.2025	499	1,03	400 Internationale Staatsanleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 7,050 %, fällig am 03.02.2031 413 0,85		
80 iHeartCommunications Inc, 6,375 %, fällig am 01.05.2026	68	0,14	220 Internationale Staatsanleihe der Dominikanischen Republik, 4,875 %, fällig am 23.09.2032 196 0,41		
150 Iron Mountain Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2029	152	0,31	955 1,97		
570 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig am 15.12.2031	585	1,20	Ecuador – 0,55 % (28. Februar 2023: 0,58 %)		
270 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	267	0,55	660 Internationale Staatsanleihe Ecuador, 144A, Nullkupon, fällig am 31.07.2030 269 0,55		
540 Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.10.2031	455	0,94	Ägypten – 1,21 % (28. Februar 2023: 0,89 %)		
265 NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	261	0,54	300 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 6,588 %, fällig am 21.02.2028 271 0,56		
270 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig am 15.03.2026	264	0,54	350 Internationale Staatsanleihe Ägypten, 144A, 7,600 %, fällig am 01.03.2029 318 0,65		
60 NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, fällig am 15.01.2029	63	0,13	589 1,21		
270 Rackspace Technology Global Inc, 3,500 %, fällig am 31.05.2028	162	0,33	Jordanien – 0,92 % (28. Februar 2023: 0,79 %)		
280 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig am 15.10.2026	258	0,53	440 Internationale Staatsanleihe Jordanien, 144A, 7,750 %, fällig am 15.01.2028 446 0,92		
200 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig am 01.07.2026	193	0,40	Kenia – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,30 %)		
930 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 01.04.2028	916	1,89	200 Internationale Staatsanleihe der Republik Kenia, 144A, 7,250 %, fällig am 28.02.2028 186 0,38		
110 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, fällig am 01.03.2032	110	0,23	Mexiko – 2,24 % (28. Februar 2023: 1,29 %)		
200 Service Corp International.US, 5,125 %, fällig am 01.06.2029	196	0,40	MXN 550 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig am 29.05.2031 30 0,06		
520 Service Properties Trust, 5,500 %, fällig am 15.12.2027	490	1,01	MXN 10.720 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig am 23.11.2034 570 1,18		
120 SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, fällig am 15.12.2028 *	119	0,25	MXN 4.680 Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042 237 0,49		
290 SiriusXM Radio Inc, 144A, 4,125 %, fällig am 01.07.2030	250	0,51	300 Mexiko, internationale Staatsanleihe, 2,659 %, fällig am 24.05.2031 249 0,51		
220 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, fällig am 15.11.2031	233	0,48	1.086 2,24		
320 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	291	0,60	Nigeria – 1,20 % (28. Februar 2023: 0,40 %)		
250 Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig am 15.05.2026	117	0,24	360 Nigeria, internationale Staatsanleihe, 144A, 7,143 %, fällig am 23.02.2030 319 0,66		
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	43	0,09	300 Internationale Staatsanleihe Nigeria, 144A, 7,875 %, fällig am 16.02.2032 264 0,54		
290 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	210	0,43	583 1,20		
40 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 15.05.2029	29	0,06	Oman – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
150 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, fällig am 01.03.2027	148	0,30	200 Internationale Staatsanleihe Oman, 6,750 %, fällig am 17.01.2048 201 0,42		
240 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig am 01.09.2026	195	0,40	Panama – 0,94 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
190 Tenet Healthcare Corp, 6,250 %, fällig am 01.02.2027	190	0,39	650 Panama, internationale Staatsanleihe, 2,252 %, fällig am 29.09.2032 457 0,94		
170 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	169	0,35	Senegal – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,28 %)		
250 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig am 15.04.2026	237	0,49	230 Internationale Staatsanleihe Senegal, 144A, 6,750 %, fällig am 13.03.2048 167 0,34		
450 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig am 15.02.2029	399	0,82	Südafrika – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,32 %)		
240 TransDigm Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 01.12.2031	246	0,51	250 Internationale Staatsanleihe der Republik Südafrika, 5,650 %, fällig am 27.09.2047 183 0,38		
200 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.04.2029	185	0,38	Türkei – 1,14 % (28. Februar 2023: 1,46 %)		
550 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig am 15.11.2027	518	1,07	360 Internationale Staatsanleihe Türkei, 4,250 %, fällig am 14.04.2026 346 0,71		
50 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, fällig am 01.06.2031	51	0,10	300 Internationale Staatsanleihe Türkei, 4,875 %, fällig am 16.04.2043 208 0,43		
40 Viasat Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 30.05.2031	28	0,06	554 1,14		
120 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 15.02.2029	116	0,24	Ukraine – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,15 %)		
120 Vistra Operations Co LLC, 144A, 7,750 %, fällig am 15.10.2031	124	0,26	450 Internationale Staatsanleihe Ukraine, 144A, 7,750 %, fällig am 01.09.2028 129 0,27		
230 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 15.04.2029	107	0,22			
190 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig am 15.02.2031	196	0,40			
90 XPO Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 01.02.2032	92	0,19			
	19.106	39,38			
Sambia – 0,47 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig am 01.03.2029	228	0,47			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 41.084 \$)					
	37.563	77,42			
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 18,60 % (28. Februar 2023: 17,71 %)					
Angola – 0,60 % (28. Februar 2023: 0,52 %)					
330 Internationale Staatsanleihe Angola, 144A, 8,750 %, fällig am 14.04.2032	290	0,60			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)		
USA – 1,03 % (28. Februar 2023: 4,50 %)		
500 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 03.05.2024	500	1,03
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 10.082 \$)	9.022	18,60
Schuldscheindarlehen – 1,08 % (28. Februar 2023: 0,31 %)		
200 DCert Buyer, Inc., 9,333 %, fällig am 16.10.2026 *	199	0,41
200 Redstone Holdco 2 LP, 10,201 %, fällig am 27.04.2028 *	166	0,34
300 WW International Inc, 8,947 %, fällig am 13.04.2028 *	158	0,33
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 603 \$)	523	1,08
Stammaktien – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Schweiz: 0,42 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
1.680 Credit Suisse Group AG Escrow †∞	206	0,42
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)	206	0,42
Optionsscheine – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
USA – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
4 flyExclusive Inc	2	–
Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 3 \$)	2	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 52.019 \$)	47.559	98,02
Devisenterminkontrakte – 0,07 % (28. Februar 2023: 0,10 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	34	0,07
Futures – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,07 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	8	0,02
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	47.601	98,11
Devisenterminkontrakte – –0,05 % (28. Februar 2023: 0,47 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-24	-0,05
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-24	-0,05
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	47.577	98,06
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	942	1,94
Gesamtnettovermögen	48.519 \$	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD –	Verkauf AUD –	USD –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 51	Verkauf AUD 77	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 29	Verkauf EUR 26	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 67	Verkauf GBP 52	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 21	Verkauf GBP 17	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 7	Verkauf SGD 10	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 27	Verkauf SGD 36	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD 6.542	Verkauf USD 4.267	-12
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD 29	Verkauf USD 21	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD 2.350	Verkauf USD 1.751	-3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 30	Verkauf USD 39	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 2.930	Verkauf USD 3.687	13
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 80	Verkauf USD 87	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1.515	Verkauf USD 1.630	8
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 1.289	Verkauf GBP 1.011	13
19. Apr. 2024	Citi	Kauf EUR 450	Verkauf USD 496	-9
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 60 \$)				\$ 34
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -271 \$)				-24
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -211 \$)				\$ 10

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro FX Currency März 2024	UBS	-23	\$ -3.108
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 38 \$)			\$ 8
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)			–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 38 \$)			\$ 8

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 27.219.000 \$ und machten 56,10 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.
- † Illiquide
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- ∞ Das Wertpapier ist zum 29. Februar 2024 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

ABKÜRZUNGEN:

- Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling
- MXN – Mexikanischer Peso

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,39
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	1,05
Finanzderivate	0,08
Sonstige Vermögenswerte	4,48
Gesamtvermögen	100,00

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 10,61 % (28. Februar 2023: 14,21 %)					
Frankreich – 2,33 % (28. Februar 2023: 1,32 %)					
SGD 8.000	Credit Agricole SA, 3,800 %, fällig am 30.04.2031 *	5,840	2,33		
Indien – 1,47 % (28. Februar 2023: 0,80 %)					
4.000	REC Ltd, 2,250 %, fällig am 01.09.2026	3,686	1,47		
Indonesien – 2,80 % (28. Februar 2023: 2,30 %)					
3.350	Pelabuhan Indonesia Persero PT, 5,375 %, fällig am 05.05.2045	3,183	1,27		
4.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, fällig am 15.05.2027	3,829	1,53		
		7,012	2,80		
Katar – 3,53 % (28. Februar 2023: 2,05 %)					
IDR 140.000.000	QNB Finance Ltd, 6,900 %, fällig am 23.01.2025	8,849	3,53		
Supranational – 0,48 % (28. Februar 2023: 1,46 %)					
INR 100.000	International Finance Corp, 6,300 %, fällig am 25.11.2024	1,202	0,48		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 28.287 \$)					
		26,589	10,61		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 86,27 % (28. Februar 2023: 83,94 %)					
Australien – 1,72 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
AUD 7.000	Australia Staatsanleihe, 3,750 %, fällig am 21.04.2037	4,317	1,72		
China – 19,09 % (28. Februar 2023: 17,35 %)					
CNY 110.000	Agricultural Development Bank of China, Series 1806, 4,650 %, fällig am 11.05.2028	16,670	6,65		
CNY 96.500	Chinesische Staatsanleihe, 3,600 %, fällig am 21.05.2030	14,176	5,66		
CNY 68.500	Chinesische Staatsanleihe, Series INBK, 3,120 %, fällig am 25.10.2052	10,499	4,19		
CNY 5.000	Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, fällig am 14.05.2024	696	0,28		
CNY 40.000	Export-Import Bank of China/The, Series 2010, 3,230 %, fällig am 23.03.2030	5,802	2,31		
		47,843	19,09		
Indien – 11,08 % (28. Februar 2023: 7,70 %)					
INR 300.000	Indische Staatsanleihe, Series SPB, 8,240 %, fällig am 15.02.2027	3,729	1,49		
INR 350.000	Indische Staatsanleihe, 7,170 %, fällig am 08.01.2028	4,232	1,69		
INR 400.000	Indische Staatsanleihe, 7,610 %, fällig am 09.05.2030	4,942	1,97		
INR 300.000	Indische Staatsanleihe, 7,260 %, fällig am 22.08.2032	3,653	1,46		
INR 190.000	Indische Staatsanleihe, 6,570 %, fällig am 05.12.2033	2,205	0,88		
INR 460.000	Indische Staatsanleihe, 7,180 %, fällig am 24.07.2037	5,575	2,22		
INR 280.000	Indische Staatsanleihe, 7,300 %, fällig am 19.06.2053	3,438	1,37		
		27,774	11,08		
Indonesien – 8,48 % (28. Februar 2023: 10,13 %)					
IDR 71.585.000	Indonesische Staatsanleihe, Series FR97, 7,125 %, fällig am 15.06.2043	4,695	1,87		
IDR 160.000.000	Indonesische Staatsanleihe, Serie FR89, 6,875 %, fällig am 15.08.2051	10,156	4,05		
IDR 100.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series OB, 8,250 %, fällig am 15.08.2024	6,410	2,56		
		21,261	8,48		
Malaysia – 11,52 % (28. Februar 2023: 11,48 %)					
MYR 32.780	Malaysische Staatsanleihe, Series O122, 3,582 %, fällig am 15.07.2032	6,768	2,70		
MYR 98.770	Malaysische Staatsanleihe, Series O318, 4,642 %, fällig am 07.11.2033	22,100	8,82		
		28,868	11,52		
Philippinen – 5,03 % (28. Februar 2023: 4,92 %)					
PHP 756.000	Internationale Staatsanleihe Philippinen, 6,250 %, fällig am 14.01.2036	12,614	5,03		
Singapur – 4,74 % (28. Februar 2023: 6,16 %)					
SGD 6.250	National Environment Agency, 2,500 %, fällig am 15.09.2051	3,983	1,59		
SGD 11.000	Singapur, Staatsanleihe, 2,625 %, fällig am 01.08.2032	7,897	3,15		
		11,880	4,74		
Südkorea – 15,28 % (28. Februar 2023: 18,25 %)					
IDR 50.000.000	Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, fällig am 02.12.2024	3,179	1,27		
KRW 14.300.000	Koreanische Staatsanleihe, Series 2912, 1,375 %, fällig am 10.12.2029	9,596	3,83		
KRW 12.800.000	Koreanische Staatsanleihe, Series 3006, 1,375 %, fällig am 10.06.2030	8,506	3,40		
KRW 13.200.000	Koreanische Staatsanleihe, Series 3206, 3,375 %, fällig am 10.06.2032	9,878	3,94		
KRW 13.000.000	Koreanische Staatsanleihe, Series 3909, 1,125 %, fällig am 10.09.2039	7,121	2,84		
		38,280	15,28		
Thailand – 7,55 % (28. Februar 2023: 5,38 %)					
THB 641.030	Thailändische Staatsanleihe, 3,300 %, fällig am 17.06.2038	18,911	7,55		
Vietnam: 1,78 % (28. Februar 2023: 0,34 %)					
4500	Vietnam, internationale Staatsanleihe, 4,800 %, fällig am 19.11.2024	4,467	1,78		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 241.108 \$)					
		216,215	86,27		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,18 % (28. Februar 2023: 0,88 %)					
5476	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5,476	2,18		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 5.476 \$)					
		5,476	2,18		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 274.871 \$)					
		248,280	99,06		
Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2023: 0,04 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	34	0,01		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
		248,314	99,07		
Devisenterminkontrakte – -0,07 % (28. Februar 2023: 0,26 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-182	-0,07		
Futures – -0,03 % (28. Februar 2023: 0,09 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-82	-0,03		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
		-264	-0,10		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
		248,050	98,97		
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte					
		2578	1,03		
Gesamtnettvermögen					
		250,628 \$	100,00		
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A	Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.179.000 USD und machten 1,27 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.				
ABKÜRZUNGEN:					
AUD	– Australischer Dollar				
CNY	– Chinesischer Renminbi				
IDR	– Indonesische Rupiah				
INR	– Indische Rupie				
KRW	– Südkoreanischer Won				
MYR	– Malaysischer Ringgit				
PHP	– Philippinischer Peso				
SGD	– Singapur-Dollar				
THB	– Thailändischer Baht				
Verteilung des Gesamtvermögens					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
96,26					
Organismen für gemeinsame Anlagen					
2,17					
Finanzderivate					
0,01					
Sonstige Vermögenswerte					
1,56					
Gesamtvermögen					
100,00					

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)		
8. März 2024	Citi	Kauf	USD	8.487	Verkauf	NZD	14.000	\$ -37
8. März 2024	Citi	Kauf	NZD	7.000	Verkauf	USD	4.302	-39
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	121	Verkauf	AUD	187	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	CNH	40	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	500	Verkauf	CNH	3.603	-2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	121	Verkauf	EUR	112	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	237	Verkauf	EUR	218	1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	205	Verkauf	SGD	275	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	SGD	14	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CHF	14	Verkauf	USD	16	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	-	Verkauf	USD	-	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	17.218	Verkauf	USD	11.228	-31
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CNH	158.254	Verkauf	USD	22.037	-54
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CNH	10.700	Verkauf	USD	1.486	1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	5.739	Verkauf	USD	6.176	32
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	3.004	Verkauf	USD	2.236	-3
27. März 2024	JP Morgan	Kauf	SGD	18.100	Verkauf	USD	13.484	-16
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 162 \$)							\$	34
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.130 \$)								-182
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -968 \$)							\$	-148

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
Korea 10 Year Bond März 2024	UBS	57	\$ 4.809	\$ -82
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): - \$)				\$ -
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -373 \$)				-82
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -373 \$)				\$ -82

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,46
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,23
Finanzderivate	0,73
Sonstige Vermögenswerte	2,58
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2028	23.140	\$ -498
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 213 \$)				\$ -
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)				-498
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 213 \$)				\$ -498

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 2.442	Verkauf EUR 2.255	\$ 2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 1.261	Verkauf EUR 1.171	-4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 3.577	Verkauf GBP 2.829	6
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 3.230	Verkauf GBP 2.562	-7
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 153	Verkauf SEK 1.581	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 352	Verkauf SEK 3.709	-5
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 222.328	Verkauf USD 279.707	966
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK 116.989	Verkauf USD 11.097	197
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CHF 4.184	Verkauf USD 4.824	-84
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 57.683	Verkauf USD 62.093	289
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK 281	Verkauf USD 26	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1.750	Verkauf USD 1.896	-4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 1.020	Verkauf USD 1.288	-2
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf USD 20.829	Verkauf EUR 19.222	-10
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf USD 21.507	Verkauf GBP 16.841	241
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf EUR 7.560	Verkauf USD 8.160	36
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD 9.529	Verkauf EUR 8.845	-61
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD 31.135	Verkauf EUR 28.706	13
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD 12.665	Verkauf GBP 9.922	135
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD 194	Verkauf JPY 27.973	5
13. Mai 2024	Citi	Kauf EUR 705	Verkauf USD 760	4
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 28.197	Verkauf EUR 25.990	19
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 22.242	Verkauf GBP 17.428	233
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 554	Verkauf JPY 79.998	14
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf GBP 2.421	Verkauf USD 3.040	17
13. Mai 2024	HSBC	Kauf USD 29.216	Verkauf EUR 26.919	31
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD 44.313	Verkauf EUR 40.823	54
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD 6.663	Verkauf GBP 5.220	71
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf GBP 530	Verkauf USD 667	3
13. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 33.726	Verkauf EUR 31.061	50
13. Mai 2024	Royal Bank of Canada	Kauf USD 16.734	Verkauf GBP 13.106	183
13. Mai 2024	UBS	Kauf USD 30.601	Verkauf EUR 28.183	45
13. Mai 2024	UBS	Kauf USD 21.351	Verkauf GBP 16.724	231
13. Mai 2024	UBS	Kauf GBP 500	Verkauf USD 627	4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 3.707 \$)				\$ 2.849
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.219 \$)				-177
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 488 \$)				\$ 2.672

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ minderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-338	\$ -42.456	\$ 489
Euro-Bund März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-136	-19.498	130
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-12	-11.707	-76
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	161	17.780	19
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-24	-2.566	-6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 4.839 \$)				\$ 638
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -61 \$)				-82
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 4.778 \$)				\$ 556

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^Δ

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettowert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettowert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Italien – 0,69 % (28. Februar 2023: 0,74 %)					
EUR	850	0,69	850	896	0,69
Luxemburg – 0,76 % (28. Februar 2023: 0,42 %)					
EUR	330	0,22	330	285	0,22
EUR	620	0,47	620	609	0,47
EUR	100	0,07	100	83	0,07
Niederlande – 0,19 % (28. Februar 2023: 0,97 %)					
	80	0,06	80	71	0,06
	150	0,10	150	131	0,10
	60	0,03	60	43	0,03
Spanien – 0,70 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
EUR	400	0,35	400	449	0,35
EUR	500	0,35	500	462	0,35
Schweiz – 0,50 % (28. Februar 2023: 1,41 %)					
EUR	290	0,24	290	311	0,24
EUR	100	0,08	100	101	0,08
	250	0,18	250	230	0,18
Vereinigte Arabische Emirate – 0,59 % (28. Februar 2023: 0,50 %)					
	530	0,33	530	431	0,33
EUR	400	0,26	400	335	0,26
Vereinigtes Königreich – 2,88 % (28. Februar 2023: 2,96 %)					
GBP	670	0,66	670	854	0,66
GBP	100	0,09	100	119	0,09
	365	0,28	365	357	0,28
EUR	550	0,45	550	583	0,45
GBP	1.000	0,99	1.000	1.285	0,99
EUR	140	0,10	140	135	0,10
	460	0,31	460	398	0,31
USA – 13,90 % (28. Februar 2023: 15,12 %)					
	100	0,08	100	98	0,08
	120	0,09	120	114	0,09
	320	0,25	320	275	0,25
	80	0,05	80	69	0,05
	40	0,03	40	33	0,03
	90	0,06	90	72	0,06
	184	0,12	184	154	0,12
	34	0,02	34	23	0,02
	330	0,21	330	278	0,21
	160	0,12	160	157	0,12
	945	0,62	945	808	0,62
	400	0,30	400	390	0,30
	27	0,02	27	27	0,02
	190	0,14	190	177	0,14
	130	0,08	130	103	0,08
	130	0,10	130	128	0,10
	60	0,04	60	56	0,04
	180	0,13	180	172	0,13
	140	0,09	140	117	0,09
	110	0,07	110	85	0,07
	110	0,07	110	92	0,07
	320	0,24	320	311	0,24
	230	0,13	230	172	0,13
	130	0,09	130	117	0,09
	290	0,24	290	308	0,24
	130	0,10	130	130	0,10
	120	0,09	120	118	0,09
	350	0,26	350	341	0,26
	260	0,19	260	252	0,19
	80	0,05	80	71	0,05
	93	0,07	93	89	0,07
	85	0,06	85	76	0,06
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 35.453 \$)					
				32.126	24,82
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 55,88 % (28. Februar 2023: 53,61 %)					
Belgien – 0,57 % (28. Februar 2023: 0,56 %)					
EUR	640	0,57	640	736	0,57
				17.991	13,90

^Δ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Brasilien – 1,73 % (28. Februar 2023: 1,50 %)					
BRL 1.000	Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie B, Series NTN, 6,000 %, fällig am 15.05.2035	0,68			
BRL 7.000	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	1,05			
		2,241			1,73
Kanada – 1,59 % (28. Februar 2023: 1,63 %)					
CAD 1.190	Kanadische Staatsanleihe, 2,750 %, fällig am 01.06.2033	0,64			
CAD 900	Province of Ontario Canada, 3,450 %, fällig am 02.06.2045	0,45			
CAD 1.000	Province of Quebec Canada, 3,500 %, fällig am 01.12.2045	0,50			
		2,053			1,59
Frankreich – 1,65 % (28. Februar 2023: 2,99 %)					
EUR 1.670	Staatsanleihe der französischen Republik OAT, 0,000 %, fällig am 25.05.2032	1,11			
EUR 670	Staatsanleihe der französischen Republik OAT, 144A, 1,500 %, fällig am 25.05.2050	0,39			
EUR 160	Staatsanleihe der französischen Republik OAT, 4,000 %, fällig am 25.04.2060	0,15			
		2,138			1,65
Deutschland – 11,08 % (28. Februar 2023: 2,84 %)					
EUR 7.020	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.08.2028	5,33			
EUR 670	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2031	0,48			
EUR 1.070	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig am 15.08.2032	0,85			
EUR 1.670	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,600 %, fällig am 15.08.2033	1,42			
EUR 1.990	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series VL, 0,500 %, fällig am 15.04.2030	2,08			
EUR 1.110	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig am 19.06.2024	0,92			
		14,336			11,08
Indonesien – 1,22 % (28. Februar 2023: 1,19 %)					
IDR 21.645.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR79, 8,375 %, fällig am 15.04.2039	1,22			
		1,578			1,22
Italien – 1,13 % (28. Februar 2023: 0,99 %)					
EUR 1.570	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, fällig am 01.09.2046	1,13			
		1,461			1,13
Japan – 1,76 % (28. Februar 2023: 5,86 %)					
JPY 14.850	Japanische 30-jährige Staatsanleihe, Series 59, 0,700 %, fällig am 20.06.2048	0,06			
JPY 444.950	Japanische 30-jährige Staatsanleihe, Series 66, 0,400 %, fällig am 20.03.2050	1,70			
		2,191			1,76
Mexiko – 3,98 % (28. Februar 2023: 4,03 %)					
MXN 76.620	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	3,00			
EUR 590	Internationale Staatsanleihe Mexiko, 2,875 %, fällig am 08.04.2039	0,39			
EUR 830	Internationale Staatsanleihe Mexiko, 5,550 %, fällig am 21.01.2045	0,59			
		5,157			3,98
Niederlande – 0,63 % (28. Februar 2023: 0,51 %)					
EUR 970	BNG Bank NV, 0,010 %, fällig am 05.10.2032	0,63			
Norwegen – 1,02 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
NOK 2.420	Norwegische Staatsanleihe, Series 484, 144A, 2,125 %, fällig am 18.05.2032	0,16			
NOK 12.680	Norwegische Staatsanleihe, Series 486, 144A, 3,000 %, fällig am 15.08.2033	0,86			
		1,319			1,02
Polen – 1,44 % (28. Februar 2023: 1,32 %)					
PLN 9.630	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig am 25.04.2032	1,44			
		1,864			1,44
Südafrika – 1,36 % (28. Februar 2023: 1,55 %)					
ZAR 56.582	Staatsanleihe Republik Südafrika, Series R214, 6,500 %, fällig am 28.02.2041	1,36			
		1,754			1,36
Südkorea – 1,42 % (28. Februar 2023: 1,23 %)					
KRW 2.533.840	Koreanische Schatzanleihe, Series 2606, 1,875 %, fällig am 10.06.2026	1,42			
		1,842			1,42
Spanien – 0,55 % (28. Februar 2023: 1,44 %)					
EUR 190	Spanische Staatsanleihe, 144A, 5,150 %, fällig am 31.10.2044	0,19			
EUR 520	Spanische Staatsanleihe, Serie 30Y, 2,700 %, fällig am 31.10.2048	0,36			
		714			0,55
Vereinigtes Königreich – 5,04 % (28. Februar 2023: 5,56 %)					
GBP 2.660	Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig am 06.07.2032	2,64			
GBP 1.610	Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig am 12.07.2040	1,54			
GBP 550	United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig am 22.07.2065	0,34			
		444			0,34
			530	United Kingdom Inflation-Linked Gilt, Series 3MO, 0,125 %, fällig am 22.03.2068	0,52
			674		0,52
			6.526		5,04
USA – 19,71 % (28. Februar 2023: 19,91 %)					
			3.120	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig am 15.07.2033	2,33
			11.550	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig am 15.04.2024	8,87
			5.540	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig am 31.08.2025	4,00
			1.980	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig am 31.10.2028	1,34
			130	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig am 15.05.2043	0,09
			20	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.11.2047	0,01
			1.990	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	1,16
			2.020	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig am 15.05.2052	1,18
			20	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	0,01
			80	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.02.2053	0,06
			970	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	0,66
			25.512		19,71
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 79.108 \$)					
Organismen für gemeinsame Anlagen – 9,19 % (28. Februar 2023: 7,65 %)					
			724	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	8,19
			9	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ Accumulating	1,00
			1.292		1,00
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 11.528 \$)					
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 149.751 \$)					
			138.973		107,38
Kontrakte (in Tsd.)					
Gekaufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,01 %)					
			1.790	USD Call/MXN Put 17.60, fällig am 13.03.2024 – JP Morgan	–
			1		–
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 24 \$)					
Devisenterminkontrakte – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,69 %)					
				Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	0,42
Futures – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,23 %)					
				Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	0,04
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
			139.568		107,84
Nennwert (in Tsd.)					
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 0,32 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
			-500	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	-0,32
			-412		-0,32
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten -411 \$)					
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten -411 \$)					
			-412		-0,32
Kontrakte (in Tsd.)					
Verkaufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
			-1.820	USD Put/MXN Call 16.50, fällig am 13.03.2024 – JP Morgan	–
			–		–
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -6 \$)					
Devisenterminkontrakte – 0,29 % (28. Februar 2023: 1,43 %)					
				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-0,29
Futures – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,71 %)					
				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-0,18
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
			-1.013		-0,79
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
			138.555		107,05
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten					
			-9.135		-7,05
Gesamtnettovermögen					
			129.420		100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 6.187.000 USD und machten 4,79 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.
- ± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.
- β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	87,23
Organismen für gemeinsame Anlagen	8,16
Finanzderivate	0,41
Sonstige Vermögenswerte	4,20
Gesamtvermögen	100,00

ABKÜRZUNGEN:

TBA	– To be announced.
BRL	– Brasilianischer Real
CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
IDR	– Indonesische Rupiah
JPY	– Japanischer Yen
KRW	– Südkoreanischer Won
MXN	– Mexikanischer Peso
NOK	– Norwegische Krone
PLN	– Polnischer Zloty
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2024	Citi	Kauf USD 8.303	Verkauf CNH 59.070	\$ 99
13. März 2024	Citi	Kauf USD 296	Verkauf INR 24.760	-2
13. März 2024	Citi	Kauf CNH 11.610	Verkauf USD 1.629	-17
13. März 2024	Citi	Kauf INR 24.760	Verkauf USD 299	–
13. März 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 1.874	Verkauf CNH 13.250	33
13. März 2024	JP Morgan	Kauf USD 1.571	Verkauf CNH 11.110	28
13. März 2024	JP Morgan	Kauf USD 1.954	Verkauf KRW 2.554.455	36
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 156	Verkauf EUR 145	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 34	Verkauf EUR 32	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 2.959	Verkauf NZD 4.844	10
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf NZD 4.873	Verkauf USD 2.956	11
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 2	Verkauf USD 2	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf NZD 3.992	Verkauf USD 2.455	-25
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD 99.712	Verkauf USD 73.765	-276
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 20.973	Verkauf USD 22.568	114
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf USD 8.668	Verkauf EUR 7.996	-2
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf PLN 761	Verkauf USD 190	–
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD 5.129	Verkauf EUR 4.729	2
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD 4.311	Verkauf GBP 3.378	46
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD 70	Verkauf MXN 1.233	-1
13. Mai 2024	Citi	Kauf SEK 14.650	Verkauf USD 1.414	4
13. Mai 2024	Citi	Kauf ZAR 3.520	Verkauf USD 183	-1
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD 191	Verkauf ZAR 3.599	5
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 130	Verkauf EUR 120	–
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 307	Verkauf MXN 5.374	-4
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf JPY 140.969	Verkauf USD 976	-25
13. Mai 2024	HSBC	Kauf USD 8.323	Verkauf EUR 7.668	9
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD 852	Verkauf CAD 1.143	9
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD 2.989	Verkauf CNH 21.360	11
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD 7.139	Verkauf EUR 6.575	10
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD 6.037	Verkauf GBP 4.730	64
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf EUR 872	Verkauf USD 942	3
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf GBP 98	Verkauf USD 124	–
13. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 1.991	Verkauf EUR 1.834	3
13. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 2.215	Verkauf GBP 1.735	24
13. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf JPY 10.958	Verkauf USD 76	-2
13. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf AUD 1.657	Verkauf USD 1.095	-15
13. Mai 2024	UBS	Kauf USD 9.093	Verkauf EUR 8.374	14
13. Mai 2024	UBS	Kauf EUR 2.573	Verkauf USD 2.782	7
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1.011 \$)				542
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.097 \$)				-371
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.086 \$)				171

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ minderung von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	92	\$ 21.965	\$ 13
Australia 10 Year Bond März 2024	Bank of America Merrill Lynch	16	1.196	14
Euro-Bobl März 2024	Bank of America Merrill Lynch	11	1.382	-7
Euro-BTP März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-18	-2.292	-6
Euro-Bund März 2024	Bank of America Merrill Lynch	56	8.029	-57
Euro-Schatz März 2024	Bank of America Merrill Lynch	52	5.909	-51
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-9	-8.780	-58
Long Gilt Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	11	1.362	9
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	18	1.988	5
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-87	-9.933	-40
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	104	21.294	-11
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	32	3.421	4
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	5	596	3
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	3	384	4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 338 \$)				\$ 52
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.043 \$)				-230
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -705 \$)				\$ -178

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 91,86 % (28. Februar 2023: 80,76 %)			Luxemburg – 3,80 % (28. Februar 2023: 2,48 %)		
Australien – 0,51 % (28. Februar 2023: 1,56 %)			110 ArcelorMittal SA, 6,550 %, fällig am 29.11.2027		
			10 ArcelorMittal SA, 6,750 %, fällig am 01.03.2041	115	0,37
			100 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625 %, fällig am 20.10.2028	10	0,03
			100 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,625 %, fällig am 20.04.2030	108	0,35
Belgien – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,39 %)			170 Logisor Financing Sarl, 3,250 %, fällig am 13.11.2028		
			190 P3 Group Sarl, 4,625 %, fällig am 13.02.2030	152	0,49
			150 Logisor Financing Sarl, 3,250 %, fällig am 13.11.2028	154	0,50
			125 Prologis International Funding II SA, 1,750 %, fällig am 15.03.2028	204	0,66
			140 SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig am 20.11.2025	126	0,40
			140 SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig am 20.11.2025	145	0,47
			160 SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig am 20.12.2026	163	0,53
				1.177	3,80
Brasilien – 0,21 % (28. Februar 2023: 1,03 %)			Niederlande – 3,01 % (28. Februar 2023: 2,39 %)		
			200 ABN AMRO Bank NV, 3,875 %, fällig am 15.01.2032		
			100 Cooperatieve Rabobank UA, 3,822 %, fällig am 26.07.2034		
			200 CTP NV, Series emTN, 4,750 %, fällig am 05.02.2030		
			130 Enexis Holding NV, 3,625 %, fällig am 12.06.2034		
			140 Euronext NV, 1,000 %, fällig am 18.04.2025		
			100 Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1,750 %, fällig am 02.04.2027		
				103	0,33
				934	3,01
Kolumbien – 0,41 % (28. Februar 2023: 0,25 %)			Portugal – 1,01 % (28. Februar 2023: 0,40 %)		
			200 EDP – Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig am 02.08.2081 *		
			100 Floene Energias SA, 4,875 %, fällig am 03.07.2028		
				202	0,65
				112	0,36
				314	1,01
Dänemark – 1,57 % (28. Februar 2023: 2,07 %)			Singapur – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,40 %)		
			200 Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125 %, fällig am 19.11.2025		
				206	0,67
Finnland – 1,45 % (28. Februar 2023: 0,67 %)			Spanien – 2,73 % (28. Februar 2023: 3,53 %)		
			100 Aena SME SA, 4,250 %, fällig am 13.10.2030		
			200 Banco Santander SA, 5,294 %, fällig am 18.08.2027		
			100 Banco Santander SA, 4,875 %, fällig am 18.10.2031		
			100 Banco Santander SA, 5,750 %, fällig am 23.08.2033 *		
			100 CaixaBank SA, 6,875 %, fällig am 25.10.2033 *		
			200 Ccellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig am 15.02.2033		
				847	2,73
Frankreich – 9,44 % (28. Februar 2023: 7,01 %)			Schweden – 2,44 % (28. Februar 2023: 1,88 %)		
			140 H&M Finance BV, 0,250 %, fällig am 25.08.2029		
			100 Heimstaden AB, 4,250 %, fällig am 09.03.2026		
			130 Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, fällig am 09.03.2026		
			160 Svenska Handelsbanken AB, 5,000 %, fällig am 16.08.2034 *		
			200 Swedbank AB, 7,750 %, fällig am 29.05.2028		
			100 Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 5,375 %, fällig am 29.05.2028		
				112	0,36
				756	2,44
Deutschland – 8,31 % (28. Februar 2023: 7,27 %)			Schweiz – 1,43 % (28. Februar 2023: 2,96 %)		
			200 UBS Group AG, 2,250 %, fällig am 09.06.2028 *		
			200 UBS Group AG, 4,125 %, fällig am 09.06.2033 *		
				228	0,74
				216	0,69
				444	1,43
Irland – 0,60 % (28. Februar 2023: 0,64 %)			Vereinigtes Königreich – 14,54 % (28. Februar 2023: 13,41 %)		
			130 Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000 %, fällig am 31.07.2028		
			210 Barclays Plc, 6,375 %, fällig am 09.03.2032		
			170 Cadent Finance Plc, 0,750 %, fällig am 11.03.2032		
			120 CPMK Finance Ltd, 3,588 %, fällig am 28.08.2025		
			160 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig am 07.04.2026		
			100 Gatwick Funding Ltd, 2,500 %, fällig am 15.04.2030		
			180 Grainger Plc, 3,000 %, fällig am 03.07.2030		
			200 HSBG Holdings Plc, 2,357 %, fällig am 18.08.2031 *		
			160 Legal & General Group Plc, 4,500 %, fällig am 01.11.2050 *		
			180 Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, fällig am 15.12.2031 *		
			200 Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, fällig am 16.07.2035 *		
			200 Marston's Issuer Plc, Series B1, 7,890 %, fällig am 16.07.2035 *		
			290 NatWest Group Plc, 4,500 %, fällig am 12.06.2031		
			100 RELX Finance BV, 3,750 %, fällig am 27.06.2027		
			140 Rentokil Initial Finance BV, 3,875 %, fällig am 11.10.2029		
			140 Smith & Nephew Plc, 4,565 %, fällig am 11.10.2029		
			170 SSE Plc, 4,000 %, fällig am 09.09.2030 *		
			270 Standard Chartered Plc, 2,500 %, fällig am 27.07.2029		
			150 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 0,375 %, fällig am 27.07.2029		
			100 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750 %, fällig am 27.04.2030		
			130 Tritax EuroBox Plc, 0,950 %, fällig am 02.06.2026		
			100 UNITE Group Plc/The, 3,500 %, fällig am 15.10.2028		
			200 Vodafone Group Plc, 8,000 %, fällig am 30.08.2086 *		
			100 Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig am 31.05.2027		
			100 Whitbread Group Plc, 3,000 %, fällig am 31.05.2031		
			100 WPP Finance SA, 4,125 %, fällig am 30.05.2028		
				110	0,35
				4.507	14,54
				2.574	8,31
Irland – 0,60 % (28. Februar 2023: 0,64 %)			Italien – 4,06 % (28. Februar 2023: 3,22 %)		
			180 CA Auto Bank SPA/Ireland, 0,500 %, fällig am 13.09.2024		
			200 Enel Finance International NV, 144A, 7,750 %, fällig am 14.10.2052		
			200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig am 01.06.2032 *		
			190 Snam SpA, 3,875 %, fällig am 19.02.2034		
			100 Terna – Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, fällig am 23.09.2029 *		
			340 UniCredit SpA, 2,000 %, fällig am 23.09.2029 *		
				1.260	4,06
				187	0,60
Israel – 0,50 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Italien – 4,06 % (28. Februar 2023: 3,22 %)		
			180 CA Auto Bank SPA/Ireland, 0,500 %, fällig am 13.09.2024		
			200 Enel Finance International NV, 144A, 7,750 %, fällig am 14.10.2052		
			200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig am 01.06.2032 *		
			190 Snam SpA, 3,875 %, fällig am 19.02.2034		
			100 Terna – Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, fällig am 23.09.2029 *		
			340 UniCredit SpA, 2,000 %, fällig am 23.09.2029 *		
				1.260	4,06

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – 34,82 % (28. Februar 2023: 27,84 %)					
EUR	190	0,375		48	0,16
	19.11.2027			55	0,19
110	101	0,32		100	0,30
200	189	0,61		160	0,53
110	101	0,33		50	0,16
60	60	0,19		110	0,35
				120	0,29
EUR	120	0,43		100	0,30
	133			170	0,54
45	45	0,14		100	0,30
150	147	0,47		30	0,10
50	45	0,15		30	0,10
90	90	0,29		120	0,37
50	50	0,16		30	0,10
				103	0,33
				89	0,29
EUR	50	0,11		78	0,25
290	294	0,95		80	0,31
80	79	0,25		100	0,32
160	111	0,36		110	0,38
90				40	0,11
	78	0,25		90	0,31
40	29	0,09		130	0,37
17	16	0,05		100	0,32
160	148	0,48		50	0,16
				120	0,37
EUR	120	0,43		17	0,05
120	95	0,31		120	0,35
180				116	0,37
	119	0,38		130	0,47
20	19	0,06		50	0,16
140	120	0,39		120	0,35
220	154	0,50		210	0,68
100	101	0,33		89	0,29
180	229	0,74		116	0,37
70	65	0,21		60	0,17
170	172	0,56		130	0,41
80	78	0,25		50	0,16
	144	0,47		90	0,29
EUR	150	0,47		20	0,04
230	254	0,82		107,92	34,82
160	143	0,46			
70	70	0,23			
38	36	0,12			
130	113	0,36			
40	42	0,14			
30	31	0,10			
130	120	0,39			
	40	0,12			
	50	0,16			
EUR	180	0,61			
	111	0,36			
EUR	110	0,36			
	138	0,44			
	14	0,04			
EUR	170	0,59			
	110	0,33			
	20	0,06			
EUR	120	0,38			
	70	0,21			
130	116	0,37			
	50	0,16			
	20	0,06			
100	91	0,29			
90	93	0,30			
	20	0,06			
EUR	500	1,58			
	30	0,06			
20	14	0,04			
	100	0,32			
240	239	0,77			
150	104	0,34			
EUR	340	1,22			
	50	0,18			
100	87	0,26			
EUR	230	0,80			
	30	0,10			
60	54	0,17			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 31.090 \$) 28.475 91,86					
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 2,53 % (28. Februar 2023: 13,07 %)					
Indonesien – 1,03 % (28. Februar 2023: 0,63 %)					
EUR	350	1,03		318	1,03
Mexiko – 1,12 % (28. Februar 2023: 1,10 %)					
				348	1,12
USA – 0,38 % (28. Februar 2023: 3,61 %)					
				69	0,22
				49	0,16
				118	0,38
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 925 \$) 784 2,53					
Organismen für gemeinsame Anlagen: 0,22 % (28. Februar 2023: 1,21 %)					
				69	0,22
				69	0,22
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 69 \$) 69 0,22					
Stammaktien – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
Schweiz – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
				83	0,27
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$) 83 0,27					
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 32.084 \$) 29.411 94,88					
Devisenterminkontrakte – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,74 %)					
				90	0,29
Futures – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,44 %)					
				82	0,27
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 29.583 95,44					
Credit Default Swaps – 0,61 % (28. Februar 2023: 0,17 %)					
				-188	-0,61
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: -0,19 %)					
				(1)	-

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Futures – -0,07 % (28. Februar 2023: 0,08 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-21	-0,07
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-210	-0,68
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	29.373	94,76
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	1.624	5,24
Gesamtvermögen	30.997 \$	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.950.000 USD und machten 6,26 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.

† Nicht liquide.

∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.

ABKÜRZUNGEN:

Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

EUR – Euro

GBP – Britisches Pfund Sterling

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,67
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,22
Finanzderivate	0,55
Sonstige Vermögenswerte	5,56
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2028	4.200	\$ -86
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2028	1.940	-42
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 5,000 % – Kauf	20. Dez. 2028	710	-60
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -76 \$)				-188
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -76 \$)				\$ -188

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	67 \$ -1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf GBP	– –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD	20 –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD	4.724 24
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD	30 –
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf USD	Verkauf EUR	1.256 –
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf USD	Verkauf EUR	40 –
13. Mai 2024	BNP Paribas	Kauf EUR	Verkauf USD	378 1
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD	Verkauf EUR	939 –
13. Mai 2024	Citi	Kauf USD	Verkauf GBP	279 4
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf CAD	38 1
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf EUR	6.099 4
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf GBP	308 4
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf JPY	9.414 2
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf EUR	Verkauf USD	323 2
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf CAD	Verkauf USD	23 –
13. Mai 2024	HSBC	Kauf USD	Verkauf EUR	60 –
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf EUR	942 1
13. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf GBP	1.375 19
13. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf USD	Verkauf EUR	1.276 3
13. Mai 2024	Royal Bank of Canada	Kauf USD	Verkauf EUR	738 1
13. Mai 2024	UBS	Kauf USD	Verkauf EUR	3.564 6
13. Mai 2024	UBS	Kauf USD	Verkauf GBP	1.307 18
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 343 \$)				\$ 90
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -90 \$)				-1
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 253 \$)				\$ 89

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ minderung von Kontrakten (in Tsd.)
10 Year Mini Japanese Government Bond März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-1	\$ -98	\$ -1
Euro-Bobl März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-24	-3.015	37
Euro-Bund März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-12	-1.720	21
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Bank of America Merrill Lynch	2	288	-1
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-2	-1.951	-12
Long Gilt Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-5	-619	-3
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	23	2.540	6
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	11	1.256	4
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	11	1.176	1
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-8	-954	-4
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	14	1.790	13
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 202 \$)				\$ 82
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -34 \$)				-21
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 168 \$)				\$ 61

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert					
Forderungenbesicherte Wertpapiere – 5,12 % (28. Februar 2023: 4,57 %)			29.991	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig am 01.10.2046	20.321 1,68					
11.500	Apidos CLO XXXVI, Series 2021 36A, Class D, 144A, 8,479 %, fällig am 20.07.2034 *	11.386	0,95		27.992	2,32				
9.070	Apidos CLO XXXVIII, Series 2021 38A, Class D, 144A, 8,529 %, fällig am 21.01.2034 *	8.974	0,74	Italien – 0,23 % (28. Februar 2023: 0,13 %)						
7.650	Bain Capital Credit CLO 2021-4 Ltd, Series 2021 4A, Class D, 144A, 8,679 %, fällig am 20.10.2034 *	7.401	0,61	2.750	Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, fällig am 07.10.2039	2.756	0,23			
3.000	Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class DR, 144A, 8,576 %, fällig am 15.07.2030 *	2.978	0,25	Luxemburg – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
2.630	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Class 2A, 5,572 %, fällig am 15.01.2037 *	2.401	0,20	220	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig am 15.08.2029	190	0,02			
7.116	DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig am 20.11.2051	5.956	0,49	Macau – 1,76 % (28. Februar 2023: 1,08 %)						
2.040	Loanpal Solar Loan Ltd, Series 2020 3GS, Class B, 144A, 3,450 %, fällig am 20.12.2047	1.567	0,13	7.690	Sands China Ltd, 5,125 %, fällig am 08.08.2025	7.585	0,63			
5.375	Nassau 2021-I Ltd, Series 2021 IA, Class D, 144A, 9,326 %, fällig am 26.08.2034 *	5.273	0,44	3.462	Sands China Ltd, 2,550 %, fällig am 03.08.2027	3.121	0,26			
5.110	Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class DR, 144A, 9,296 %, fällig am 15.10.2034 *	5.052	0,42	1.540	Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 08.03.2029	1.330	0,11			
2.350	Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class D, 144A, 11,138 %, fällig am 20.01.2035 *	2.356	0,20	3.570	Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig am 01.10.2024	3.537	0,30			
4.772	Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class A, 144A, 2,675 %, fällig am 28.02.2033	4.346	0,36	5.750	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2026	5.581	0,46			
4.000	Vibrant Clo VII Ltd, Series 2017 7A, Class C, 144A, 9,179 %, fällig am 15.09.2030 *	3.980	0,33			21.154	1,76			
Summe forderungenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 64.458 \$)			61.670	5,12	Malaysia – 0,65 % (28. Februar 2023: 0,39 %)					
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 9,47 % (28. Februar 2023: 0,91 %)						11.710	Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig am 19.08.2050	7.865	0,65	
10.400	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1M2, 144A, 6,972 %, fällig am 25.12.2041 *	10.452	0,87	Mexiko – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,43 %)						
7.700	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	7.289	0,61	3.610	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, Ewige Anleihe *	3.531	0,29			
13.600	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	13.190	1,09	Supranational – 0,45 % (28. Februar 2023: 0,37 %)						
5.500	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,500 % ±	5.441	0,45	IDR	86.776.600	European Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig am 06.10.2026	5.375	0,45		
12.000	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,000 % ±	12.049	1,00	Schweden – 0,31 % (28. Februar 2023: 0,18 %)						
32	Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, fällig am 12.01.2047	29	–	4.400	Svenska Handelsbanken AB, 4,750 %, Ewige Anleihe *	3.694	0,31			
7.870	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class M2, 144A, 6,822 %, fällig am 25.10.2041 *	7.858	0,65	Schweiz – 1,30 % (28. Februar 2023: 2,18 %)						
10.700	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	10.219	0,85	4.290	UBS Group AG, 144A, 9,016 %, fällig am 15.11.2033 *	5.164	0,43			
34.200	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	33.409	2,77	1.110	UBS Group AG, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	1.113	0,09			
12.900	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	12.816	1,06	1.000	UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	1.107	0,09			
1.088	MortgageIT Trust 2005-3, Series 2005 3, Class A1, 6,035 %, fällig am 25.08.2035 *	1.027	0,09	2.000	UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	2.140	0,18			
343	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQZR, Class A3, 144A, 1,353 %, fällig am 25.10.2058 *	310	0,03	6.160	UBS Group AG, 6,875 %, Ewige Anleihe *	6.099	0,51			
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 114.023 \$)			114.089	9,47	Vereinigte Arabische Emirate – 0,54 % (28. Februar 2023: 0,37 %)					
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 37,74 % (28. Februar 2023: 40,30 %)						8.260	MDGH GMTN RSC Ltd, 3,950 %, fällig am 21.05.2050	6.493	0,54	
Bermuda – 1,07 % (28. Februar 2023: 0,61 %)						Vereinigtes Königreich – 0,49 % (28. Februar 2023: 0,65 %)				
12.900	Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig am 15.10.2025	12.896	1,07	1.310	BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig am 15.08.2047	984	0,08			
Brasilien – 0,49 % (28. Februar 2023: 0,38 %)						2.040	Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Ewige Anleihe *	2.039	0,17	
1.780	Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, fällig am 27.01.2028	1.792	0,15	270	Reynolds American Inc, 6,150 %, fällig am 15.09.2043	261	0,02			
4.380	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig am 05.06.2115	4.095	0,34	700	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig am 15.05.2029	657	0,06			
			5.887	0,49	2.330	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,250 %, fällig am 31.01.2031	1.978	0,16		
Kanada – 0,36 % (28. Februar 2023: 0,20 %)						USA – 24,53 % (28. Februar 2023: 26,93 %)				
2.400	Bank of Nova Scotia/The, 8,000 %, fällig am 27.01.2084 *	2.429	0,20	850	Altria Group Inc, 5,950 %, fällig am 14.02.2049	847	0,07			
260	Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, fällig am 31.10.2082 *	271	0,02	2.395	Altria Group Inc, 6,200 %, fällig am 14.02.2059	2.443	0,20			
1.670	Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig am 15.12.2027	1.602	0,14	557	Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig am 22.08.2057	480	0,04			
			4.302	0,36	1.830	Amazon.com Inc, 2,700 %, fällig am 03.06.2060	1.130	0,09		
Kolumbien – 0,84 % (28. Februar 2023: 0,47 %)						4.440	Amazon.com Inc, 4,100 %, fällig am 13.04.2062	3.684	0,31	
4.130	Ecopetrol SA, 5,375 %, fällig am 26.06.2026	4.067	0,34	550	American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 15.05.2029	579	0,05			
2.510	Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig am 13.01.2033	2.641	0,22	17.736	Apache Corp, 5,100 %, fällig am 01.09.2040	14.857	1,23			
3.430	Ecopetrol SA, 8,375 %, fällig am 19.01.2036	3.446	0,28	140	Apache Corp, 7,375 %, fällig am 15.08.2047	138	0,01			
			10.154	0,84	1.933	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	1.404	0,12		
Frankreich – 1,26 % (28. Februar 2023: 0,78 %)						4.500	BAC Capital Trust XIV, Series G, 6,046 %, Ewige Anleihe *	3.718	0,31	
2.260	Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2028	1.846	0,15	210	Bank of America Corp, Series X, 6,250 %, Ewige Anleihe *	210	0,02			
200	BNP Paribas SA, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	213	0,02	15.940	Bank of America Corp, Series FF, 5,875 %, Ewige Anleihe *	15.465	1,28			
1.210	BNP Paribas SA, 144A, 8,000 %, Ewige Anleihe *	1.212	0,10	1.329	Bank of America Corp, Series AA, 6,100 %, Ewige Anleihe *	1.331	0,11			
400	BNP Paribas SA, 144A, 7,000 %, Ewige Anleihe *	388	0,03	1.300	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.11.2025	1.211	0,10			
5.420	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Ewige Anleihe *	5.539	0,46	2.978	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	2.920	0,24			
GBP	Credit Agricole SA, 7,500 %, Ewige Anleihe *	6.042	0,50	2.510	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig am 15.12.2025	2.534	0,21			
			15.240	1,26	780	Boeing Co/The, 3,550 %, fällig am 01.03.2038	604	0,05		
Irland – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,02 %)						992	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig am 01.05.2060	951	0,08	
340	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	288	0,02	5.250	Carnival Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 01.05.2029	5.134	0,43			
Israel – 2,32 % (28. Februar 2023: 4,11 %)						6.150	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig am 01.06.2030	6.715	0,56	
8.027	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig am 01.02.2036	7.671	0,64	320	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	259	0,02			
						1.860	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig am 01.04.2038	1.604	0,13	
						540	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig am 01.03.2050	391	0,03	
						700	Cheniere Energy Inc, 4,625 %, fällig am 15.10.2028	673	0,06	
						800	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig am 31.01.2032	669	0,06	
						3.355	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	4.263	0,35	
						11.765	Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Ewige Anleihe *	11.679	0,97	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert			
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)								
USA – (Fortsetzung)								
6.900	Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, fällig am 15.11.2053	7.358	0,61	4.800	Range Resources Corp, 8,250 %, fällig am 15.01.2029	5.011	0,42	
1.019	CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig am 01.11.2042	871	0,07	6.910	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2040	6.810	0,57	
330	CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.09.2029	226	0,02	7.540	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,375 %, fällig am 15.07.2027	7.403	0,61	
340	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig am 15.01.2031	334	0,03	470	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig am 15.03.2032	472	0,04	
3.290	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig am 01.06.2044	2.672	0,22	670	Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	609	0,05	
5.110	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig am 01.02.2029	4.460	0,37	560	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig am 15.03.2032	677	0,06	
2.150	CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig am 15.01.2030	1.266	0,10	360	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig am 01.02.2031	341	0,03	
3.390	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 01.12.2030	2.527	0,21	280	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig am 15.01.2032	250	0,02	
2.135	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig am 03.11.2036	2.208	0,18	1.300	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig am 01.07.2038	1.297	0,11	
1.160	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig am 15.09.2037	1.236	0,10	2.100	Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, Nullkupon, fällig am 15.02.2038	715	0,06	
205	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,500 %, fällig am 20.10.2025	202	0,02	6.990	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig am 15.04.2026	6.735	0,56	
354	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	346	0,03	340	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig am 15.02.2031	301	0,02	
560	Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig am 15.06.2028	564	0,05	1.260	Warnermedia Holdings Inc, 5,391 %, fällig am 15.03.2062	1.017	0,08	
716	Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig am 15.01.2030	684	0,06	1.926	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Ewige Anleihe *	1.930	0,16	
1.690	Devon Energy Corp, 7,875 %, fällig am 30.09.2031	1.921	0,16	420	Western Midstream Operating LP, 4,500 %, fällig am 01.03.2028	402	0,03	
1.440	Devon Energy Corp, 7,950 %, fällig am 15.04.2032	1.643	0,14	5.114	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig am 01.04.2044	4.587	0,38	
805	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig am 15.06.2045	697	0,06	4.480	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 15.08.2048	3.941	0,33	
3.720	Dignity Health, 5,267 %, fällig am 01.11.2064	3.459	0,29	1.330	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig am 01.02.2050	1.177	0,10	
170	DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig am 01.12.2026	136	0,01	2.790	Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig am 15.01.2031	3.105	0,26	
90	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig am 01.12.2028	62	0,01	3.400	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig am 15.03.2032	4.059	0,34	
1.220	DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig am 01.06.2029	522	0,04	1.500	Williams Cos Inc/The, 6,300 %, fällig am 15.04.2040	1.562	0,13	
1.530	Energy Transfer LP, 6,850 %, fällig am 15.02.2040	1.586	0,13	7.313	XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig am 01.05.2034	7.575	0,63	
1.995	Energy Transfer LP, 6,100 %, fällig am 15.02.2042	1.982	0,16			295.615	24,53	
412	Energy Transfer LP, 5,400 %, fällig am 01.10.2047	374	0,03	Sambia – 0,81 % (28. Februar 2023: 0,01 %)				
410	Energy Transfer LP, 6,000 %, fällig am 15.06.2048	402	0,03	7.690	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 01.03.2026	7.690	0,64	
730	Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig am 15.04.2049	738	0,06	640	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027	609	0,05	
11.260	Energy Transfer LP, Series F, 6,750 %, Ewige Anleihe *	11.092	0,92	900	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig am 01.03.2029	934	0,07	
8.650	Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Ewige Anleihe *	8.359	0,69	600	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig am 01.06.2031	574	0,05	
4.018	Energy Transfer LP, Series H, 6,500 %, Ewige Anleihe *	3.904	0,32			9.807	0,81	
12.990	Energy Transfer LP, Series B, 6,625 %, Ewige Anleihe *	12.083	1,00	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 489.535 \$)				
828	Enterprise Products Operating LLC, 6,125 %, fällig am 15.10.2039	874	0,07			454.781	37,74	
1	Enterprise Products Operating LLC, 6,450 %, fällig am 01.09.2040	1	-	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 43,01 % (28. Februar 2023: 40,57 %)				
730	EQT Corp, 7,000 %, fällig am 01.02.2030	774	0,06	Angola – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,17 %)				
360	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	295	0,02	2.000	Internationale Staatsanleihe Angola, 8,250 %, fällig am 09.05.2028	1.844	0,15	
3.750	Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	3.746	0,31	1.250	Internationale Staatsanleihe Angola, 144A, 8,750 %, fällig am 14.04.2032	1.100	0,09	
200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,375 %, fällig am 13.11.2025	192	0,02			2.944	0,24	
200	Ford Motor Credit Co LLC, 4,542 %, fällig am 01.08.2026	194	0,02	Brasilien – 1,63 % (28. Februar 2023: 1,07 %)				
200	Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig am 10.08.2026	186	0,02	BRL	21.530	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig am 01.01.2027	4.326	0,36
3.700	Ford Motor Credit Co LLC, 4,271 %, fällig am 09.01.2027	3.546	0,29	BRL	78.647	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	15.337	1,27
200	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig am 10.02.2029	174	0,01			19.663	1,63	
760	Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig am 03.05.2029	733	0,06	Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 1,48 % (28. Februar 2023: 1,01 %)				
620	Freemont-McMoran Inc, 4,625 %, fällig am 01.08.2030	592	0,05	EUR	4.010	Internationale Staatsanleihe Ivory Coast, 4,875 %, fällig am 30.01.2032	3.644	0,30
515	Goldman Sachs Capital II, 6,370 %, Ewige Anleihe *	435	0,04	EUR	4.020	Internationale Staatsanleihe Ivory Coast, 144A, 4,875 %, fällig am 30.01.2032	3.653	0,30
2.210	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig am 01.10.2037	2.404	0,20	558	Internationale Staatsanleihe Ivory Coast, 5,750 %, fällig am 31.12.2032	527	0,04	
300	HCA Inc, 3,500 %, fällig am 01.09.2030	268	0,02	4.164	Internationale Staatsanleihe Ivory Coast, 6,125 %, fällig am 15.06.2033	3.661	0,31	
4.401	HCA Inc, 7,500 %, fällig am 15.11.2095	4.703	0,39	7.240	Internationale Staatsanleihe Ivory Coast, 144A, 6,125 %, fällig am 15.06.2033	6.365	0,53	
6.290	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 7,186 %, fällig am 21.12.2065 *	4.888	0,41			17.850	1,48	
539	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500 %, fällig am 01.09.2039	556	0,05	Dominikanische Republik – 0,81 % (28. Februar 2023: 0,35 %)				
400	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550 %, fällig am 15.09.2040	414	0,03	DOP	214.400	Internationale Staatsanleihe Dominikanische Republik, 144A, 11,250 %, fällig am 15.09.2035	4.027	0,34
2.490	Northern Oil & Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig am 01.03.2028	2.524	0,21	6.750	Internationale Staatsanleihe Dominikanische Republik, 144A, 5,875 %, fällig am 30.01.2060	5.709	0,47	
2.760	Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig am 01.09.2030	2.907	0,24			9.736	0,81	
300	Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, fällig am 01.01.2031	308	0,03	Ägypten – 0,40 % (28. Februar 2023: 0,24 %)				
5.220	Occidental Petroleum Corp, 4,300 %, fällig am 15.08.2039	4.213	0,35	EGP	22.000	Ägyptische Staatsanleihe, Series 7YR, 18,400 %, fällig am 30.05.2024	515	0,05
11.725	Occidental Petroleum Corp, 4,500 %, fällig am 15.07.2044	9.097	0,75	4.420	Internationale Staatsanleihe Ägypten, 5,250 %, fällig am 06.10.2025	4.247	0,35	
7.150	Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig am 15.06.2045	5.777	0,48			4.762	0,40	
2.050	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig am 15.03.2046	2.179	0,18	Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses				
4.520	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig am 15.04.2046	3.615	0,30	[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.				
1.370	Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig am 15.02.2047	1.009	0,08					
16.140	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig am 15.03.2048	12.397	1,03					
2.572	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig am 15.08.2049	1.914	0,16					
890	Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig am 01.08.2040	642	0,05					
2.280	Plains All American Pipeline LP, Series B, 9,679 %, Ewige Anleihe *	2.279	0,19					
1.910	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, fällig am 15.05.2036	1.996	0,17					

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert						
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Summe Kommunalanleihen (Anschaffungskosten 3.653 \$)								
Indien – 10,29 % (28. Februar 2023: 5,07 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,30 % (28. Februar 2023: 0,87 %)								
INR 800.000	Indische Staatsanleihe, 6,180 %, fällig am 04.11.2024	9.609	0,80	39.783	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	39.783	3,30				
INR 900.000	Indische Staatsanleihe, 5,630 %, fällig am 12.04.2026	10.585	0,88	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 39.783 \$)			39.783	3,30			
INR 1.300.000	Indische Staatsanleihe, 8,150 %, fällig am 24.11.2026	16.091	1,34	Schweiz – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			41.200 Credit Suisse Group AG Escrow [†] ∞				
INR 600.000	Indische Staatsanleihe, 7,170 %, fällig am 08.01.2028	7.255	0,60	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)			5.047	0,42			
INR 1.150.000	Indische Staatsanleihe, 7,590 %, fällig am 20.03.2029	14.194	1,18	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 1.273.530 \$)			1.219.901	101,24			
INR 1.350.000	Indische Staatsanleihe, 5,790 %, fällig am 11.05.2030	15.239	1,26	Kontrakte (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD				
INR 1.000.000	Indische Staatsanleihe, 7,260 %, fällig am 22.08.2032	12.176	1,01	Gekaufte Optionen – 0,43 % (28. Februar 2023: 0,28 %)							
INR 2.900.000	Indische Staatsanleihe, 6,190 %, fällig am 16.09.2034	32.594	2,70	1 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 95.75, fällig am 15.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					430	0,04	
INR 500.000	Indische Staatsanleihe, 7,540 %, fällig am 23.05.2036	6.235	0,52	– Australian Dollar Currency Future März 2024 Call 65.00, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					17	–	
		123.978	10,29	– Australian Dollar Currency Future März 2024 Call 66.00, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					5	–	
Indonesien – 5,95 % (28. Februar 2023: 7,79 %)				– British Pound Currency Future April 2024 Put 125.50, fällig am 05.04.2024 – Bank of America Merrill Lynch					67	0,01	
IDR 371.785.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR78, 8,250 %, fällig am 15.05.2029	25.511	2,12	– British Pound Currency Future März 2024 Put 125.50, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					23	–	
IDR 500.248.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR87, 6,500 %, fällig am 15.02.2031	31.626	2,62	– Euro Currency Future März 2024 Call 1.08, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					24	–	
IDR 222.343.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR96, 7,000 %, fällig am 15.02.2033	14.593	1,21	– Euro Currency Future März 2024 Call 1.0850, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					44	–	
		71.730	5,95	– Euro-Bund April 2024 Call 132.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					534	0,04	
Jamaika – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,00 %)				– Euro-Bund April 2024 Call 132.50, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					409	0,03	
JMD 141.500	Internationale Staatsanleihe Jamaika, 9,625 %, fällig am 03.11.2030	961	0,08	– Euro-Bund April 2024 Call 133.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					230	0,02	
Kenia – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,22 %)				– Euro-Bund April 2024 Call 134.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					151	0,01	
	3.670 Internationale Staatsanleihe der Republik Kenia, 7,250 %, fällig am 28.02.2028	3.408	0,28	– Euro-Bund April 2024 Call 137.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					114	0,01	
Mexiko – 7,25 % (28. Februar 2023: 5,39 %)				– Japanese Yen Currency Future März 2024 Call 67.00, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					70	0,01	
MXN 1.261.084	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	63.988	5,31	– Japanese Yen Currency Future März 2024 Call 68.50, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					5	–	
MXN 453.610	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	23.323	1,94	– U.S. 10 Year April 2024 Call 110.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					231	0,02	
		87.311	7,25	– U.S. 10 Year April 2024 Call 110.50, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					308	0,03	
Nigeria – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,14 %)				1 U.S. 5 Year April 2024 Call 106.75, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					422	0,04	
	3.240 Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 6,125 %, fällig am 28.09.2028	2.853	0,24	2 U.S. 5 Year April 2024 Call 107.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					976	0,08	
Polen – 4,68 % (28. Februar 2023: 2,62 %)				– U.S. 5 Year April 2024 Call 107.25, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					118	0,01	
PLN 291.200	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig am 25.04.2032	56.366	4,68	1 U.S. Bond April 2024 Call 120.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					563	0,05	
Südafrika – 3,73 % (28. Februar 2023: 1,46 %)				11.080 USD Call/CHF Put 0.8725, fällig am 16.03.2024 – Goldman Sachs					148	0,01	
ZAR 1.082.770	Staatsanleihe Republik Südafrika, Series R209, 6,250 %, fällig am 31.03.2036	36.582	3,03	28.340 USD Call/EUR Put 1.0850, fällig am 26.03.2024 – Goldman Sachs					222	0,02	
ZAR 271.600	Staatsanleihe Republik Südafrika, Series R214, 6,500 %, fällig am 28.02.2041	8.418	0,70	14.904 USD Put/ZAR Call 18.2095, fällig am 09.04.2024 – Goldman Sachs					18	–	
		45.000	3,73	Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 8.440 \$)			5.129	0,43			
USA – 5,95 % (28. Februar 2023: 14,05 %)				Credit Default Swaps – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,27 %)					Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
1.820	Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7,000 %, fällig am 01.10.2039	1.918	0,16	Index-Swaps – 5,59 % (28. Februar 2023: 6,92 %)					660	0,05	
2.990	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,500 %, fällig am 15.02.2053 –ß	2.698	0,22	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					67.371	5,59	
7.070	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig am 15.11.2043 =	7.278	0,60	Zinsswaps – 1,22 % (28. Februar 2023: 0,12 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
1.320	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.02.2049 =	1.023	0,09	Devisenterminkontrakte – 0,71 % (28. Februar 2023: 1,01 %)					14.619	1,22	
7.000	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig am 15.05.2050 =	3.557	0,30	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					8511	0,71	
2.570	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig am 15.11.2051 =	1.532	0,13	Futures – 1,51 % (28. Februar 2023: 0,96 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				
18.446	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.02.2052 =	12.071	1,00	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					1.334.435	110,75	
16.910	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.08.2052 =	13.077	1,09	Verkaufte Optionen – –0,66 % (28. Februar 2023: 2,17 %)			Verkaufte Optionen – –0,66 % (28. Februar 2023: 2,17 %)				
1.044	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.02.2053 =	913	0,08	-1 CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Call 96.25, fällig am 13.12.2024 – Bank of America Merrill Lynch					-587	-0,05	
2.683	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053 =	2.348	0,19	-1 CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 95.00, fällig am 15.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					-9	–	
16.500	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 15.08.2053 =	15.801	1,31	-1 CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Put 95.00, fällig am 15.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					-633	-0,05	
8.870	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig am 15.11.2053 =	9.440	0,78	Summe Kontrakte (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD				
		71.656	5,95	EUR – Euro-Bund April 2024 Call 133.50, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					-165	-0,01	
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 538.758 \$)			518.218	43,01	Summe Kontrakte (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD			
Schuldscheindarlehen – 1,92 % (28. Februar 2023: 1,98 %)				Gekaufte Optionen – 0,43 % (28. Februar 2023: 0,28 %)							
3.991	1011778 Bc ULC, 7,583 %, fällig am 21.09.2030 *	3.980	0,33	1 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 95.75, fällig am 15.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					430	0,04	
1.414	Alterra Mountain Co, 8,947 %, fällig am 30.07.2028 *	1.418	0,12	– Australian Dollar Currency Future März 2024 Call 65.00, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					17	–	
2.731	Asurion LLC, 9,683 %, fällig am 19.08.2028 *	2.721	0,22	– Australian Dollar Currency Future März 2024 Call 66.00, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					5	–	
6.018	Charter Communications Operating LLC, 7,329 %, fällig am 09.12.2030 *	5.927	0,49	– British Pound Currency Future April 2024 Put 125.50, fällig am 05.04.2024 – Bank of America Merrill Lynch					67	0,01	
2.320	GTCR W Merger Sub LLC, 8,333 %, fällig am 20.09.2030 *	2.332	0,19	– British Pound Currency Future März 2024 Put 125.50, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					23	–	
1.592	Jane Street Group LLC, 7,951 %, fällig am 26.01.2028 *	1.590	0,13	– Euro Currency Future März 2024 Call 1.08, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					24	–	
2.358	LifePoint Health Inc, 11,087 %, fällig am 16.11.2028 *	2.362	0,20	– Euro Currency Future März 2024 Call 1.0850, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					44	–	
1.309	Phoenix Guarantor Inc, 0,000 %, fällig am 13.02.2031 *	1.295	0,11	– Euro-Bund April 2024 Call 132.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					534	0,04	
1.550	Virgin Media Bristol LLC, 7,932 %, fällig am 04.01.2028 *	1.538	0,13	– Euro-Bund April 2024 Call 132.50, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					409	0,03	
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 23.319 \$)			23.163	1,92	Summe Kontrakte (in Tsd.)					Wert (in Tsd.) USD	
Kommunalanleihen – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,61 %)				Gekaufte Optionen – 0,43 % (28. Februar 2023: 0,28 %)							
	4.240 City of Detroit MI, 4,000 %, fällig am 01.04.2044	3.150	0,26	1 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 95.75, fällig am 15.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch					430	0,04	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Verkaufte Optionen – (Fortsetzung)		
EUR – Euro-Bund April 2024 Put 132.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-204	-0,02
EUR – Euro-Bund April 2024 Put 132.50, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-243	-0,02
– Japanese Yen Currency Future März 2024 Call 67.50, fällig am 08.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-6	–
– U.S. 10 Year April 2024 Call 111.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-105	-0,01
-2 U.S. 10 Year April 2024 Call 111.50, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-515	-0,04
– U.S. 10 Year April 2024 Call 112.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-25	–
-2 U.S. 10 Year April 2024 Call 112.50, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-266	-0,02
-2 U.S. 10 Year April 2024 Call 113.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-188	-0,02
-2 U.S. 10 Year April 2024 Call 113.50, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-132	-0,01
-1 U.S. 10 Year April 2024 Call 114.50, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-40	–
-1 U.S. 10 Year Juni 2024 Call 113.00, fällig am 24.05.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-369	-0,03
– U.S. 10 Year W1 März 2024 Call 109.75, fällig am 01.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-162	-0,01
– U.S. 10 Year W1 März 2024 Call 110.50, fällig am 01.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-65	-0,01
– U.S. 2 Year April 2024 Call 102.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-217	-0,02
-2 U.S. 5 Year April 2024 Call 107.75, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-457	-0,04
-1 U.S. 5 Year April 2024 Call 108.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-240	-0,02
-1 U.S. 5 Year April 2024 Call 109.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-58	-0,01
-2 U.S. 5 Year May 2024 Call 107.75, fällig am 26.04.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-942	-0,08
– U.S. Bond April 2024 Call 118.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-199	-0,02
-1 U.S. Bond April 2024 Call 121.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-571	-0,05
-2 U.S. Bond April 2024 Call 123.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-461	-0,04
-1 U.S. Bond April 2024 Call 125.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-81	-0,01
– U.S. Bond April 2024 Put 121.00, fällig am 22.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-512	-0,04
– U.S. Long Bond W1 März 2024 Call 119.00, fällig am 01.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-163	-0,01
-13.972 USD Call/BRL Put 5.0347, fällig am 24.05.2024 – Goldman Sachs	-238	-0,02
-11.080 USD Call/CHF Put 0.8890, fällig am 16.03.2024 – Goldman Sachs	-31	–
-28.340 USD Put/EUR Call 1.12, fällig am 26.03.2024 – Goldman Sachs	-2	–
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -16.057 \$)	-7.886	-0,66
Index-Swaps – -1,47 % (28. Februar 2023: 0,92 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-17.747	-1,47
Zinsswaps – -0,04 % (28. Februar 2023: 1,07 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-448	-0,04
Devisenterminkontrakte – -0,54 % (28. Februar 2023: 2,05 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-6.458	-0,54
Futures: -1,63 % (28. Februar 2023: 2,21 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-19.662	-1,63
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-52.201	-4,34
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.282.234	106,41
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-77.265	-6,41
Gesamtnettovermögen	1.204.969 \$	100,00

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 230.432.000 \$ und machten 19,14 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.
- † Nicht liquide.
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- ≠ Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 29. Februar 2024 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.
- ± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.
- β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.

ABKÜRZUNGEN:

- Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit
- TBA – To be announced.
- BRL – Brasilianischer Real
- DOP – Dominikanischer Peso
- EGP – Ägyptisches Pfund
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund
- IDR – Indonesische Rupiah
- INR – Indische Rupie
- JMD – Jamaikanischer Dollar
- MXN – Mexikanischer Peso
- PLN – Polnischer Zloty
- ZAR – Südafrikanischer Rand

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	81,64
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	1,63
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,81
Finanzderivate	8,08
Sonstige Vermögenswerte	5,84
Gesamtvermögen	100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.HY.CDSI 5 Year, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	7.914	\$ 497
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	5.300	109
Bank of America Merrill Lynch	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000 % – Verkauf	20. Juni 2026	12.479	54
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 5.762 \$)				\$ 660
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -520 \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 5.242 \$)				\$ 660

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 12,024 %	4. Jan. 2027	496.488	\$ 2835
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum MXN TIIE Banxico, erhält festen Zinssatz von 9,260 %	25. Okt. 2032	1.009.497	2286
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum MXN TIIE Banxico, erhält festen Zinssatz von 8,450 %	1. März 2033	640.415	-448
BNP Paribas	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 12,646 %	2. Jan. 2029	679.541	8462
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 12,930 %	2. Jan. 2029	73.048	1036
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.585 \$)				\$ 14619
Nicht realisierte Wertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -22.883 \$)				-448
Nettowertsteigerung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -20.298 \$)				\$ 14171

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt festen Zinssatz von 1,520 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Feb. 2047	26.146	\$ 8987
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt festen Zinssatz von 2,600 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	261.696	47548
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt festen Zinssatz von 3,220 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Mai 2032	230.335	10836
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound, erhält festen Zinssatz von 1,396 %	13. Okt. 2025	582.851	-16,199
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound, erhält festen Zinssatz von 3,950 %	31. Mai 2028	143.734	-692
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound, erhält festen Zinssatz von 4,600 %	4. Juni 2024	354.373	-856
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 147.520 \$)				\$ 67371
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -19.599 \$)				-17,747
Nettowertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 127.921 \$)				\$ 49624

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 28.002	Verkauf BRL 139.220	\$ 8
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 4.071	Verkauf BRL 20.291	-10
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf BRL 157.856	Verkauf USD 32.051	-310
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf BRL 1.655	Verkauf USD 332	1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 630	Verkauf AUD 976	-3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 224	Verkauf AUD 340	1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 376	Verkauf CHF 332	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 302	Verkauf CHF 266	2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 133	Verkauf CNH 959	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 10.791	Verkauf EUR 10.050	-81
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 15.281	Verkauf EUR 14.120	10
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 912	Verkauf GBP 720	1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 1.478	Verkauf GBP 1.174	-3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 963	Verkauf JPY 144.399	-3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 87	Verkauf NOK 927	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 93	Verkauf NOK 995	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 36	Verkauf PLN 147	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 16	Verkauf SEK 173	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 34	Verkauf SEK 353	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 1.022	Verkauf SGD 1.378	-2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 680	Verkauf SGD 913	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 47.047	Verkauf USD 59.188	205
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 129	Verkauf USD 163	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD 430	Verkauf USD 319	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 761	Verkauf USD 821	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNH 208	Verkauf USD 29	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf JPY 7.068.710	Verkauf USD 48.005	-740
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK 16	Verkauf USD 1	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf NOK 3.587	Verkauf USD 343	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf PLN 7.890	Verkauf USD 1.950	26
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK 10.883	Verkauf USD 1.030	19

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD 38.293	Verkauf USD 28.520	\$ -42
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 371.174	Verkauf USD 399.385	2.032
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD 39.643	Verkauf USD 25.850	-70
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf JPY 106.441	Verkauf USD 710	1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNH 18.883	Verkauf USD 2.629	-7
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf NOK 45.396	Verkauf USD 4.268	8
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CHF 15.422	Verkauf USD 17.783	-315
2. Apr. 2024	BNY Mellon	Kauf BRL 138.752	Verkauf USD 27.822	-7
10. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 5.535	Verkauf ZAR 103.620	152
19. Apr. 2024	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 12.966	Verkauf IDR 204.131.597	-10
19. Apr. 2024	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 12.941	Verkauf INR 1.080.186	-62
19. Apr. 2024	Bank of America Merrill Lynch	Kauf CNH 94.257	Verkauf USD 13.153	-31
19. Apr. 2024	BNP Paribas	Kauf USD 31.912	Verkauf NOK 332.188	597
19. Apr. 2024	BNP Paribas	Kauf NOK 332.188	Verkauf USD 32.524	-1.208
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 3.026	Verkauf BRL 14.996	25
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 31.978	Verkauf EUR 29.019	548
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 2.475	Verkauf EUR 2.300	-16
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 24.796	Verkauf GBP 19.455	231
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 3.936	Verkauf JPY 575.000	68
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 869	Verkauf JPY 130.000	-5
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 2.178	Verkauf MXN 37.833	-24
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 27.823	Verkauf TWD 846.706	867
19. Apr. 2024	Citi	Kauf EUR 2.400	Verkauf USD 2.640	-41
19. Apr. 2024	Citi	Kauf TWD 46.220	Verkauf USD 1.478	-7
19. Apr. 2024	Citi	Kauf EUR 8.481	Verkauf USD 9.162	24
19. Apr. 2024	Citi	Kauf JPY 780.000	Verkauf USD 5.378	-132
19. Apr. 2024	Citi	Kauf JPY 460.000	Verkauf USD 3.088	6
19. Apr. 2024	Citi	Kauf GBP 1.400	Verkauf USD 1.786	-18
19. Apr. 2024	Citi	Kauf AUD 91.376	Verkauf USD 61.095	-1.605
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 3.221	Verkauf CHF 2.820	15
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 13.130	Verkauf GBP 10.315	106
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 23.589	Verkauf JPY 3.361.205	984
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 70.090	Verkauf PLN 277.690	590
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf CHF 2.150	Verkauf USD 2.442	4
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf ZAR 17.225	Verkauf USD 914	-19
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 21.410	Verkauf ZAR 401.701	558
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf USD 16.269	Verkauf CNH 116.055	111
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf USD 72.517	Verkauf IDR 1.122.565.074	1.157
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf USD 104.001	Verkauf MXN 1.788.305	-55
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf KRW 30.410.325	Verkauf USD 23.319	-480
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf MXN 235.945	Verkauf USD 13.643	86
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 3.500	Verkauf BRL 17.268	44
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 1.910	Verkauf CAD 2.558	24
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 99.837	Verkauf INR 8.333.393	-475
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf BRL 158.167	Verkauf USD 32.001	-346
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf JPY 1.453.762	Verkauf USD 10.105	-328
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 21.504 \$)				\$ 8.511
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -43.616 \$)				-6.458
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -22.112 \$)				\$ 2.053

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-6.332	\$ -1.498.270	\$ -1.398
3 Month SOFR Index Dezember 2025	Bank of America Merrill Lynch	5563	1339084	-5.488
Australian Dollar Currency März 2024	Bank of America Merrill Lynch	28	1819	-16
British Pound Currency März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-190	-14.979	61
Euribor 3 Month Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	-426	-111.635	699
Euribor 3 Month März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-7.682	-1.994.415	5304
Euro FX Currency März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-425	-57.423	474
Euro-BTP März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-324	-41.258	-169
Euro-Bund Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-851	-121.648	304
Euro-Bund März 2024	Bank of America Merrill Lynch	2358	338062	-2.376
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Bank of America Merrill Lynch	242	34829	179
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-573	-559.011	-3.684
Japanese Yen Currency März 2024	Bank of America Merrill Lynch	933	77975	-3.053
Long Gilt Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	477	59062	390

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte – (Fortsetzung)

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
Mexican Peso Currency März 2024	Bank of America Merrill Lynch	4.233	\$ 123.794	\$ 3.243
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	1.880	207.623	372
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-7.365	-840.876	-3.415
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	2.859	585.380	-33
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	1.891	202.160	-30
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	5.840	696.420	5.136
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	2.061	263.550	2.082
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 20.467 \$)				\$ 18.244
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -47.194 \$)				-19.662
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -26.727 \$)				\$ -1.418

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 11,37 % (28. Februar 2023: 14,21 %)					
500	496	0,13	316	115	0,03
250	253	0,07	1.177	958	0,26
67	65	0,02	710	65	0,02
1.274	1.112	0,30	493	453	0,12
578	537	0,14	54	52	0,01
950	946	0,25	790	657	0,18
450	430	0,12	625	597	0,16
480	480	0,13	1.302	272	0,07
660	664	0,18	2.291	355	0,10
1.380	1.360	0,37	1.000	943	0,25
1.225	1.226	0,33	600	600	0,16
720	707	0,19	300	289	0,08
376	367	0,10	650	626	0,17
520	538	0,15	310	314	0,08
1.094	1.092	0,29	940	759	0,20
940	942	0,25	248	201	0,05
720	722	0,19	499	414	0,11
410	415	0,11	578	560	0,15
850	851	0,23	320	301	0,08
915	913	0,24	1.140	1.087	0,29
13	12	-	500	504	0,14
1.268	774	0,21	990	1.001	0,27
600	614	0,17	718	719	0,19
660	606	0,16	616	441	0,12
1.119	1.088	0,29	950	965	0,26
250	250	0,07	750	753	0,20
850	849	0,23	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 43.638 \$)		
1.000	991	0,27	42.378	11,37	
750	749	0,20	Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 14,39 % (28. Februar 2023: 12,42 %)		
300	302	0,08	1.000	930	0,25
250	236	0,06	261	213	0,06
1.000	1.001	0,27	167	36	0,01
1.700	1.705	0,46	525	434	0,12
607	593	0,16	1.430	1.345	0,36
247	244	0,07	140	116	0,03
750	759	0,20	752	736	0,20
205	158	0,04	760	731	0,20
207	202	0,05	266	255	0,07
1.000	972	0,26	714	653	0,18
1.270	1.232	0,33	430	407	0,11
507	431	0,12	790	760	0,20
500	493	0,13	409	351	0,09
			20.047	413	0,11
			1.400	1.307	0,35
			31.587	730	0,20

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
586			492		
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5, Series 2018 C5, Class A3, 3,963 %, fällig am 10.06.2051	557	0,15	Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2017-SPI1, Series 2017 SPI1, Class B, 144A, 4,115 %, fällig am 25.09.2047 *	341	0,09
710			1.000		
COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class C, 4,274 %, fällig am 10.02.2048 *	613	0,16	FS Rialto 2022-FL6 Issuer LLC, Series 2022 FL6, Class A, 144A, 7,896 %, fällig am 17.08.2037 *	1.005	0,27
490			590		
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03, Series 2019 R03, Class 1B1, 144A, 9,536 %, fällig am 25.09.2031 *	521	0,14	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-375H, Series 2017 375H, Class A, 144A, 3,475 %, fällig am 10.09.2037 *	535	0,14
356			454		
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 8,836 %, fällig am 25.10.2039 *	368	0,10	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class C, 144A, 9,615 %, fällig am 15.09.2031 *	107	0,03
260			1.000		
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 8,686 %, fällig am 25.01.2040 *	268	0,07	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30, Series 2015 GC30, Class D, 3,384 %, fällig am 10.05.2050	777	0,21
723			240		
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 8,422 %, fällig am 25.10.2041 *	740	0,20	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Klasse D, 3,345 %, fällig am 10.07.2048	209	0,06
670			52		
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1M2, 144A, 6,872 %, fällig am 25.10.2041 *	673	0,18	GSMP5 Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Series 2006 RP1, Class 1A2, 144A, 7,500 %, fällig am 25.01.2036	45	0,01
190			565		
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1B1, 144A, 8,072 %, fällig am 25.12.2041 *	193	0,05	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class C, 144A, 7,136 %, fällig am 16.06.2036 *	543	0,15
700			170		
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M2, 144A, 8,422 %, fällig am 25.03.2042 *	729	0,20	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class D, 144A, 7,786 %, fällig am 16.06.2036 *	160	0,04
250			700		
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Series 2023 R05, Class 1M2, 144A, 8,421 %, fällig am 25.06.2043 *	262	0,07	Hilton USA Trust 2016-HHV, Series 2016 HHV, Class D, 144A, 4,194 %, fällig am 05.11.2038 *	655	0,18
940			1.183		
Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1B1, 144A, 8,022 %, fällig am 25.01.2044 *	946	0,25	Impac Secured Assets Trust 2006-3, Series 2006 3, Class A7, 5,975 %, fällig am 25.11.2036 *	972	0,26
420			725		
Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1M2, 144A, 7,122 %, fällig am 25.01.2044 *	422	0,11	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR10, Series 2005 AR10, Class A2, 6,015 %, fällig am 25.06.2035 *	534	0,14
1.160			1.010		
CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C3, Class C, 4,350 %, fällig am 15.08.2048 *	974	0,26	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 0,000 %, fällig am 15.06.2035 te	13	-
940			340		
CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust, Series 2016 C5, Class A5, 3,757 %, fällig am 15.11.2048	909	0,24	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE, Series 2016 NINE, Class A, 144A, 2,854 %, fällig am 06.09.2038 *	316	0,08
360			100		
CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Series 2017 C8, Class C, 4,265 %, fällig am 15.06.2050 *	300	0,08	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Series 2015 JP1, Class C, 4,723 %, fällig am 15.01.2049 *	89	0,02
350			900		
CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust, Series 2018 CX12, Class C, 4,720 %, fällig am 15.08.2051 *	306	0,08	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class FFL, 144A, 8,463 %, fällig am 05.07.2033 *	603	0,16
1.480			280		
CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037	650	0,17	JP Morgan Resecuritization Trust Series 2009-10, Series 2009 10, Class 7A2, 144A, 5,829 %, fällig am 26.02.2037 *	116	0,03
630			500		
CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class F, 144A, 9,794 %, fällig am 15.07.2032 *	563	0,15	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C27, Series 2015 C27, Class A4, 3,753 %, fällig am 15.12.2047	483	0,13
420			1.120		
DBG5 2018-BIOD Mortgage Trust, Series 2018 BIOD, Class D, 144A, 6,914 %, fällig am 15.05.2035 *	416	0,11	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-UBS8, Series 2015 UBS8, Class C, 4,559 %, fällig am 15.12.2048 *	953	0,26
571			381		
DSL A Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 1A1B, 5,574 %, fällig am 19.04.2047 *	473	0,13	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Series 2018 MP, Class A, 144A, 4,276 %, fällig am 11.07.2040 *	339	0,09
630			1.367		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C07, Class 1B1, 9,436 %, fällig am 25.05.2030 *	681	0,18	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Series 2005 2AR, Class B1, 5,935 %, fällig am 25.04.2035 *	1.025	0,27
950			880		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01, Class 1B1, 8,986 %, fällig am 25.07.2030 *	1.015	0,27	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,398 %, fällig am 15.08.2036 *	554	0,15
84			361		
Fannie Mae Pool 'CB3880', 5,000 %, fällig am 06.01.2052	82	0,02	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,398 %, fällig am 15.08.2036 *	191	0,05
68			1.170		
First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Series 2003 FF4, Class M1, 7,243 %, fällig am 25.10.2033 *	65	0,02	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class B2, 144A, 4,250 %, fällig am 25.09.2056 *	1.091	0,29
520			370		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Class B1, 144A, 7,736 %, fällig am 25.01.2050 *	541	0,15	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQM2R, Class A3, 144A, 1,353 %, fällig am 25.10.2058 *	334	0,09
326			387		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 7,622 %, fällig am 25.08.2033 *	333	0,09	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Class 2A2, 144A, 2,694 %, fällig am 26.10.2036 *	336	0,09
125			905		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Series 2020 DNA3, Class B1, 144A, 10,536 %, fällig am 25.06.2050 *	138	0,04	OBX 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A3, 144A, 6,455 %, fällig am 25.11.2063	905	0,24
500			441		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA5, Series 2020 DNA5, Class B1, 144A, 10,122 %, fällig am 25.10.2050 *	564	0,15	PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Series 2019 3R, Class A, 144A, 9,135 %, fällig am 27.11.2031 *	440	0,12
680			227		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Series 2020 DNA6, Class B1, 144A, 8,322 %, fällig am 25.12.2050 *	714	0,19	PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 9,135 %, fällig am 29.10.2024 *	226	0,06
580			535		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Series 2021 DNA3, Class B1, 144A, 8,822 %, fällig am 25.10.2033 *	638	0,17	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class M2, 144A, 3,750 %, fällig am 25.09.2055 *	480	0,13
600			188		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B1, 144A, 8,372 %, fällig am 25.01.2034 *	633	0,17	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, Series 2017 1, Class M1, 144A, 4,000 %, fällig am 25.01.2056 *	187	0,05
680			1.042		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class B1, 144A, 8,722 %, fällig am 25.10.2041 *	701	0,19	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Series 2018 1, Class M, 4,750 %, fällig am 25.05.2057 *	1.000	0,27
710			909		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class B1, 144A, 10,072 %, fällig am 25.02.2042 *	745	0,20	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Series 2018 2, Class BX, 4,127 %, fällig am 25.11.2057 *	320	0,09
710			244		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class M2, 144A, 9,072 %, fällig am 25.02.2042 *	742	0,20	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Series 2018 3, Class M, 144A, 4,750 %, fällig am 25.08.2057 *	225	0,06
230			790		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Series 2022 DNA6, Class M2, 144A, 11,072 %, fällig am 25.09.2042 *	258	0,07	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-4, Series 2018 4, Class M, 144A, 4,750 %, fällig am 25.03.2058	725	0,19
			370		
			Sequoia Mortgage Trust 2007-2, Series 2007 2, Class 1A3, 6,074 %, fällig am 20.06.2036 *	339	0,09
			250		
			Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class C, 144A, 8,500 %, fällig am 15.11.2027 *	26	0,01
			1.410		
			Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class D, 144A, 8,500 %, fällig am 15.11.2027 *	56	0,02
			1.450		
			Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class E, 144A, 8,500 %, fällig am 15.11.2027 **	7	-
			850		
			Towd Point Mortgage Trust 2015-5, Series 2015 5, Class B3, 144A, 4,009 %, fällig am 25.05.2055 *	773	0,21
			322		
			Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Klasse A3, 144A, 6,319 %, fällig am 25.05.2068	321	0,09

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert				
Mortgage-Backed Securities – (Fortsetzung)			Kolumbien – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
847	Verus Securitization Trust 2023-8, Series 2023 8, Class A3, 144A, 6,968 %, fällig am 25.12.2068	852	0,23	940	Ecopetrol SA, 8,375 %, fällig am 19.01.2036	944	0,25		
870	Verus Securitization Trust 2023-8, Series 2023 8, Class M1, 144A, 7,454 %, fällig am 25.12.2068 *	876	0,24	Dänemark – 0,21 % (28. Februar 2023: 0,29 %)					
854	Verus Securitization Trust 2023-INV3, Series 2023 INV3, Class A3, 144A, 7,732 %, fällig am 25.11.2068 *	870	0,23	800	Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, fällig am 09.01.2026 *	803	0,21		
96	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Class A1C3, 6,395 %, fällig am 25.12.2045 *	58	0,02	Frankreich – 1,09 % (28. Februar 2023: 0,74 %)					
2.195	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust, Series 2005 AR2, Class B1, 6,230 %, fällig am 25.01.2045 *	1.839	0,49	200	Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, fällig am 01.02.2027	184	0,05		
296	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR13 Trust, Series 2006 AR13, Class 2A, 6,581 %, fällig am 25.10.2046 *	263	0,07	1.090	Altice France SA/France, 144A, 5,125 %, fällig am 15.07.2029	825	0,22		
774	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR16 Trust, Series 2006 AR16, Class 2A2, 4,335 %, fällig am 25.12.2036 *	665	0,18	600	Banjay Entertainment SASU, 144A, 8,125 %, fällig am 01.05.2029	621	0,17		
122	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust, Series 2006 AR3, Class A1B, 6,081 %, fällig am 25.02.2046 *	105	0,03	550	BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	555	0,15		
651	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class D, 4,080 %, fällig am 15.05.2048 *	546	0,15	1.830	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Ewige Anleihe *	1.870	0,50		
707	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38, Series 2017 C38, Class A4, 3,190 %, fällig am 15.07.2050	667	0,18	Deutschland – 0,53 % (28. Februar 2023: 0,78 %)					
417	Wells Fargo Mortgage Backed Securities 2006-AR5 Trust, Series 2006 AR5, Class 2A1, 5,099 %, fällig am 25.04.2036 *	385	0,10	320	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2028	301	0,08		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 57.103 \$)			53.632	14,39	EUR	100	Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig am 30.09.2025	107	0,03
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 58,98 % (28. Februar 2023: 59,17 %)			Argentinien – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,35 %)			330	TK Elevator US Newco Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.07.2027	318	0,08
						950	ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 29.04.2025	937	0,25
						310	ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 14.04.2030	323	0,09
						Guatemala – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,11 %)			
						315	Millicom International Cellular SA, 144A, 6,250 %, fällig am 25.03.2029	306	0,08
						363	Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, fällig am 27.04.2031	314	0,09
						Hongkong – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,29 %)			
						230	Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig am 06.06.2025	225	0,06
						730	Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig am 04.12.2029	657	0,18
						Irland – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,33 %)			
						630	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	533	0,14
						420	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, fällig am 15.04.2026	405	0,11
						Israel – 0,70 % (28. Februar 2023: 0,50 %)			
						650	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig am 01.02.2036	621	0,17
						520	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig am 01.10.2026	482	0,13
						500	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig am 09.05.2027	476	0,13
						590	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig am 09.05.2029	558	0,15
						680	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig am 01.10.2046	461	0,12
						Italien – 0,80 % (28. Februar 2023: 0,46 %)			
						475	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig am 15.01.2026	471	0,13
						1.280	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 7,800 %, fällig am 28.11.2053	1.385	0,37
						530	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig am 02.04.2034 *	541	0,14
						640	UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig am 30.06.2035 *	592	0,16
						Kasachstan – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,20 %)			
						690	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750 %, fällig am 19.04.2027	668	0,18
						230	QazaqGaz NC JSC, 144A, 4,375 %, fällig am 26.09.2027	215	0,06
						Kuwait – 0,14 % (28. Februar 2023: 0,27 %)			
						530	MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, fällig am 18.05.2030	535	0,14
						Luxemburg – 0,73 % (28. Februar 2023: 0,94 %)			
						620	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig am 15.08.2029	535	0,14
						1.650	Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig am 15.05.2027	1.079	0,29
						500	ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig am 30.06.2027	214	0,06
						740	Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig am 01.04.2028	904	0,24
						Macau – 0,82 % (28. Februar 2023: 0,82 %)			
						270	Sands China Ltd, 5,125 %, fällig am 08.08.2025	266	0,07
						270	Sands China Ltd, 2,550 %, fällig am 03.08.2027	243	0,06
						480	Sands China Ltd, 5,400 %, fällig am 08.08.2028	469	0,13

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Macau – (Fortsetzung)					
200 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 08.03.2029	173	0,05	400 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 30.09.2027	387	0,10
200 Sands China Ltd, 3,250 %, fällig am 08.08.2031	167	0,04	560 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig am 15.06.2030	561	0,15
1.770 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig am 01.10.2024	1.754	0,47	1.130 Akumin Inc, 144A, 9,000 %, fällig am 01.08.2027	922	0,25
	3.072	0,82	1.500 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig am 15.02.2028	752	0,20
Malaysia – 0,14 % (28. Februar 2023: 0,12 %)					
790 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig am 19.08.2050	531	0,14	300 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig am 15.07.2026	299	0,08
Mexiko – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,35 %)					
1020 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,500 %, Ewige Anleihe *	1.000	0,27	340 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig am 14.02.2049	339	0,09
Niederlande – 0,55 % (28. Februar 2023: 0,48 %)					
EUR 400 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, Ewige Anleihe *	397	0,11	340 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 15.02.2029	235	0,06
EUR 1.400 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Ewige Anleihe *	1.466	0,39	384 American Airlines 2017-1 Class B Pass Through Trust, Series B, 4,950 %, fällig am 15.02.2025	378	0,10
GBP 130 GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV, 8,500 %, fällig am 15.01.2031	177	0,05	610 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig am 15.02.2028	616	0,17
	2.040	0,55	480 American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 15.05.2029	505	0,14
Peru – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig am 19.06.2047	137	0,04	23 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 20.04.2026	22	0,01
Singapur – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,08 %)					
220 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig am 19.06.2024	219	0,06	1.300 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.04.2029	1.273	0,34
Südafrika – 0,07 % (28. Februar 2023: 0,09 %)					
310 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig am 18.03.2031	258	0,07	2.576 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig am 01.09.2026	2.869	0,77
Supranational – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
INR 115.000 Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig am 06.10.2030	1.412	0,38	190 Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig am 01.03.2030	181	0,05
Schweden – 0,12 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
470 Stena International SA, 144A, 7,250 %, fällig am 15.01.2031	468	0,12	610 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2027	600	0,16
Schweiz – 1,00 % (28. Februar 2023: 1,75 %)					
720 Credit Suisse AG/New York NY, 4,750 %, fällig am 09.08.2024	717	0,19	450 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	327	0,09
250 Credit Suisse AG/New York NY, 3,625 %, fällig am 09.09.2024	248	0,07	760 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 15.02.2030	681	0,18
860 UBS Group AG, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	862	0,23	90 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, fällig am 15.12.2024	90	0,02
890 UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	952	0,25	350 Ball Corp, 2,875 %, fällig am 15.08.2030	297	0,08
750 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, fällig am 01.05.2027	636	0,17	340 Ball Corp, 3,125 %, fällig am 15.09.2031	287	0,08
390 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500 %, fällig am 01.06.2028	329	0,09	120 Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig am 01.02.2028	117	0,03
	3.744	1,00	800 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 01.10.2030	805	0,22
Türkei – 0,19 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
700 Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig am 28.02.2025	700	0,19	410 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.11.2025	382	0,10
Vereinigte Arabische Emirate – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,23 %)					
260 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig am 25.09.2048	244	0,07	280 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig am 01.02.2027	180	0,05
740 Shell Drilling Holdings Ltd, 144A, 9,625 %, fällig am 15.04.2029	715	0,19	140 Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 15.01.2028	65	0,02
	959	0,26	1.650 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	1.618	0,43
Vereinigtes Königreich – 2,79 % (28. Februar 2023: 1,64 %)					
GBP 810 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig am 07.04.2026	988	0,26	320 Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.09.2028	303	0,08
500 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,375 %, fällig am 15.01.2029	477	0,13	1.190 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig am 15.12.2025	1.201	0,32
1300 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,750 %, fällig am 15.01.2032	1.236	0,33	600 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig am 01.05.2050	579	0,16
EUR 320 Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, Ewige Anleihe *	337	0,09	400 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.05.2029	368	0,10
600 Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Ewige Anleihe *	600	0,16	1.030 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 01.02.2032	906	0,24
480 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	474	0,13	480 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,250 %, fällig am 15.04.2028	462	0,12
1.812 McLaren Finance Plc, 144A, 7,500 %, fällig am 01.08.2026	1.588	0,43	610 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig am 01.07.2031	641	0,17
GBP 1.270 NatWest Group Plc, 4,500 %, Ewige Anleihe *	1.343	0,36	420 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2030	431	0,12
960 Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625 %, fällig am 15.05.2025	959	0,26	1.480 Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 15.02.2032	1.492	0,40
GBP 980 Saga Plc, 5,500 %, fällig am 15.07.2026	1.103	0,29	1.000 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig am 01.03.2027	988	0,27
750 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig am 15.05.2029	703	0,19	420 Carnival Corp, 144A, 4,000 %, fällig am 01.08.2028	388	0,10
200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,250 %, fällig am 31.01.2031	170	0,04	150 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig am 01.06.2030	164	0,04
330 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031	286	0,08	620 Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, fällig am 01.05.2028	677	0,18
GBP 130 Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15.07.2026	140	0,04	530 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig am 15.10.2029	459	0,12
	10.404	2,79	520 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 15.05.2029	453	0,12
USA – 41,27 % (28. Februar 2023: 42,60 %)					
2.927 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig am 01.03.2028	3.028	0,81	2.330 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig am 01.02.2031	1.876	0,50
330 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig am 01.05.2028	296	0,08	380 CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125 %, fällig am 01.05.2025	372	0,10
286 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.03.2028	273	0,07	170 CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, fällig am 15.02.2029	152	0,04
			1.410 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig am 15.02.2029	1.421	0,38
			80 Charles Schwab Corp/The, 2,900 %, fällig am 03.03.2032	68	0,02
			390 Charles Schwab Corp/The, 5,853 %, fällig am 19.05.2034 *	396	0,11
			320 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig am 01.04.2033 Charter Communications Operating LLC / Charter	280	0,08
			520 Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig am 01.04.2038 Charter Communications Operating LLC / Charter	181	0,05
			1.080 Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig am 01.07.2049 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 01.06.2026	395	0,11
				1.082	0,29

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
830	760	0,20	1.380	1.271	0,34
1.100	947	0,25	270	249	0,07
1.460	915	0,25	530	544	0,15
220	176	0,05	60	55	0,02
500	510	0,14	370	333	0,09
760	721	0,19	570	563	0,15
610	614	0,17	300	279	0,08
330	318	0,09	620	617	0,17
1.110	1.039	0,28	900	935	0,25
570	514	0,14	490	450	0,12
620	425	0,11	290	273	0,07
910	893	0,24	526	576	0,15
670	685	0,18	870	806	0,22
80	75	0,02	710	552	0,15
400	419	0,11	260	239	0,06
380	336	0,09	370	351	0,09
1.480	1.054	0,28	1.176	1.110	0,30
840	868	0,23	70	76	0,02
1.370	1.433	0,38	150	120	0,03
1.160	865	0,23	450	401	0,11
690	719	0,19	740	606	0,16
1.000	986	0,26	580	412	0,11
770	727	0,20	200	197	0,05
1.280	1.211	0,33	970	948	0,25
210	134	0,04	290	305	0,08
570	456	0,12	1.120	1.089	0,29
400	278	0,07	130	126	0,03
1.400	1.021	0,27	1.040	987	0,27
730	762	0,20	570	575	0,15
1.030	879	0,24	340	350	0,09
210	203	0,05	1.020	1.034	0,28
623	629	0,17	2.790	–	–
220	200	0,05	1.000	986	0,26
260	263	0,07	1.050	1.102	0,30
500	483	0,13	810	853	0,23
30	30	0,01	1.660	1.930	0,52
260	243	0,07	310	231	0,06
420	389	0,10	120	112	0,03
170	170	0,05	1.190	1.088	0,29
190	192	0,05	1.214	1.112	0,30
850	904	0,24	470	421	0,11
360	361	0,10	910	398	0,11
80	85	0,02	1.230	1.203	0,32
810	768	0,21	980	1.086	0,29
250	238	0,06	290	298	0,08
220	188	0,05	680	680	0,18
915	936	0,25	2.025	2.047	0,55
940	797	0,21	370	380	0,10
2.380	1.953	0,52	400	385	0,10
1.250	1.066	0,29	880	807	0,22
2.130	1.985	0,53	918	892	0,24
1.500	1.408	0,38	120	72	0,02
90	71	0,02	1.140	1.190	0,32
480	434	0,12	770	716	0,19
1.540	1.575	0,42	1.670	1.483	0,40
580	593	0,16	230	191	0,05
930	971	0,26			
520	470	0,13			
370	412	0,11			
650	629	0,17			
340	365	0,10			
580	578	0,16			
400	422	0,11			
150	128	0,03			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
630 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, fällig am 15.07.2038	640	0,17	840 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, fällig am 01.02.2032	885	0,24
800 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig am 01.07.2026	771	0,21	290 Vericast Corp, 144A, 11,000 %, fällig am 15.09.2026	305	0,08
230 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 31.08.2026	228	0,06	200 Vericast Corp, 144A, 12,500 %, fällig am 15.12.2027	227	0,06
180 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 8,250 %, fällig am 15.01.2029	191	0,05	1.060 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig am 15.11.2028	979	0,26
360 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 9,250 %, fällig am 15.01.2029	387	0,10	160 Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750 %, fällig am 01.10.2029	139	0,04
950 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 7,250 %, fällig am 15.01.2030	988	0,27	460 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig am 15.09.2027	450	0,12
260 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig am 15.03.2032	261	0,07	870 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig am 15.07.2031	942	0,25
240 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,750 %, fällig am 31.07.2028	246	0,07	980 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig am 15.02.2028	942	0,25
600 RXO Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 15.11.2027	620	0,17	30 Western Midstream Operating LP, 3,100 %, fällig am 01.02.2025	29	0,01
320 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, fällig am 01.03.2032	319	0,09	1.270 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig am 01.04.2044	1.139	0,31
200 Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 144A, 6,125 %, fällig am 01.02.2028	200	0,05	1.000 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig am 01.03.2048	863	0,23
390 Service Properties Trust, 5,500 %, fällig am 15.12.2027	368	0,10	220 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig am 15.03.2032	263	0,07
120 Service Properties Trust, 144A, 8,625 %, fällig am 15.11.2031	127	0,03	960 Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 15.07.2028	948	0,25
1.480 SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, fällig am 15.12.2028 *	1.469	0,39	550 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 15.04.2029	255	0,07
300 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, fällig am 01.11.2028	291	0,08	1.050 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig am 15.02.2031	1.085	0,29
1.110 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, fällig am 15.11.2031	1.177	0,32	620 XPO Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 01.06.2028	623	0,17
1.240 Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig am 15.09.2028	1.291	0,35	310 XPO Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 01.02.2032	315	0,08
1.060 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	964	0,26	770 Ziff Davis Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.10.2030	691	0,19
508 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	368	0,10		153.796	41,27
1.550 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	1.122	0,30	Sambia – 0,61 % (28. Februar 2023: 0,83 %)		
500 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig am 15.03.2032	604	0,16	1.150 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027	1.095	0,30
390 State Street Corp, Series I, 6,700 %, Ewige Anleihe *	390	0,10	1.120 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig am 01.03.2029	1.162	0,31
720 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 15.05.2029	523	0,14		2.257	0,61
540 StoneX Group Inc, 144A, 7,875 %, fällig am 01.03.2031	547	0,15	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 225.022 \$)		
320 Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 9,000 %, fällig am 15.10.2026	317	0,09		219.804	58,98
1.050 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig am 01.09.2026	855	0,23	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 4,55 % (28. Februar 2023: 5,45 %)		
260 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 31.12.2030	242	0,07	Angola – 0,16 % (28. Februar 2023: 0,07 %)		
550 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig am 01.02.2031	522	0,14	460 Internationale Staatsanleihe Angola, 144A, 8,750 %, fällig am 14.04.2032	405	0,11
190 Tenet Healthcare Corp, 4,625 %, fällig am 15.06.2028	181	0,05	230 Internationale Staatsanleihe Angola, 9,125 %, fällig am 26.11.2049	185	0,05
310 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig am 15.06.2039	293	0,08		590	0,16
1.390 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	1.381	0,37	Argentinien – 0,59 % (28. Februar 2023: 0,68 %)		
660 TKC Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 15.05.2028	619	0,17	8 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig am 09.07.2029	3	–
1.030 TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, fällig am 15.03.2029	924	0,25	47 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,750 %, fällig am 09.07.2030	22	0,01
40 TopBuild Corp, 144A, 4,125 %, fällig am 15.02.2032	35	0,01	2.904 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,375 %, fällig am 01.09.2037	1.129	0,30
200 TransDigm Inc, 144A, 6,375 %, fällig am 01.03.2029	201	0,05	385 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 6,375 %, fällig am 01.09.2037	150	0,04
430 TransDigm Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 01.12.2031	442	0,12	1.074 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig am 01.06.2027	881	0,24
1.180 TransDigm Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 01.03.2032	1.189	0,32		2.185	0,59
970 Triumph Group Inc, 144A, 9,000 %, fällig am 15.03.2028	1.015	0,27	Bahamas – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,19 %)		
300 Truist Financial Corp, 5,122 %, fällig am 26.01.2034 *	285	0,08	220 Internationale Anleihe der Regierung der Bahamas, 8,950 %, fällig am 15.10.2032	207	0,06
410 Truist Financial Corp, 5,867 %, fällig am 08.06.2034 *	410	0,11	Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,36 % (28. Februar 2023: 0,26 %)		
1.000 Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, fällig am 01.05.2025	990	0,27	1.400 Internationale Staatsanleihe Ivory Coast, 144A, 7,625 %, fällig am 30.01.2033	1.357	0,36
139 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig am 15.01.2026	137	0,04	Dominikanische Republik – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,23 %)		
80 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig am 15.04.2026	77	0,02	160 Internationale Staatsanleihe Dominikanische Republik, 4,500 %, fällig am 30.01.2030	145	0,04
1.610 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.04.2029	1.487	0,40	940 Internationale Staatsanleihe der Dominikanischen Republik, 4,875 %, fällig am 23.09.2032	838	0,22
280 United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig am 15.05.2027	278	0,07		983	0,26
100 United Rentals North America Inc, 4,875 %, fällig am 15.01.2028	97	0,03	Ägypten – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
1.330 United Rentals North America Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.12.2029	1.332	0,36	260 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 7,053 %, fällig am 15.01.2032	216	0,06
930 United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig am 15.01.2030	901	0,24	El Salvador – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
99 US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust, 3,950 %, fällig am 15.11.2025	96	0,03	70 Internationale Staatsanleihe El Salvador, 6,375 %, fällig am 18.01.2027	61	0,02
310 US Bancorp, 4,839 %, fällig am 01.02.2034 *	292	0,08	Ghana – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
440 US Bancorp, 5,836 %, fällig am 12.06.2034 *	445	0,12	220 Internationale Anleihe der ghanaischen Regierung, 10,750 %, fällig am 14.10.2030	138	0,04
396 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig am 28.06.2028	334	0,09	Jamaika – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
180 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 15.08.2029	162	0,04	JMD 30.000 Internationale Staatsanleihe Jamaika, 9,625 %, fällig am 03.11.2030	204	0,05
1.090 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, fällig am 15.01.2030	1.089	0,29	Jordanien – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,21 %)		
200 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 15.08.2031	176	0,05	560 Internationale Staatsanleihe Jordanien, 144A, 7,750 %, fällig am 15.01.2028	567	0,15
290 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 01.11.2033	243	0,07	200 Internationale Staatsanleihe Jordanien, 7,500 %, fällig am 13.01.2029	198	0,05
480 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, fällig am 01.06.2031	486	0,13		765	0,20

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Kenia – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
1.150			620		0,17
			868		0,23
			227		0,06
			194		0,05
			109		0,03
			253		0,07
			384		0,10
			800		0,21
			691		0,18
			192		0,05
			516		0,13
			1.120		0,30
			789		0,17
			407		0,11
			506		0,14
			731		0,19
			130		0,03
			247		0,07
			973		0,26
			196		0,04
			438		0,12
			367		0,10
			417		0,11
			242		0,07
			247		0,07
			260		0,07
			200		0,05
			Summe Schuldseindarlehen (Anschaffungskosten 26.162 \$)	26.120	7,01
Mexiko – 1,45 % (28. Februar 2023: 0,65 %)					
MXN	13.270	0,19			
MXN	58.110	0,89			
	710	0,19			
	790	0,18			
		1,45			
Nigeria – 0,13 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
	340	0,08			
	260	0,05			
		0,13			
Senegal – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
	200	0,04			
Sri Lanka – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
	210	0,03			
Ukraine – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
	830	0,06			
USA – 0,56 % (28. Februar 2023: 0,57 %)					
	2.070	0,56			
Uruguay – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
UYU	8.130	0,08			
Usbekistan – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
	220	0,05			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 17.070 \$)			16.959	4,55	
Schuldseindarlehen – 7,01 % (28. Februar 2023: 5,09 %)					
	430	0,11			
	457	0,12			
	439	0,12			
	279	0,07			
	87	0,02			
	3	–			
	319	0,09			
	34	0,01			
	67	0,02			
	240	0,06			
	191	0,05			
	567	0,15			
	193	0,05			
	316	0,08			
	89	0,02			
	247	0,07			
	218	0,06			
	710	0,19			
	259	0,06			
	873	0,23			
	628	0,17			
	559	0,15			
	444	0,12			
	247	0,07			
	1.700	0,42			
	790	0,21			
	597	0,16			
	637	0,17			
	252	0,07			
	103	0,02			
	397	0,11			
	529	0,14			
	4	–			
	790	0,23			
	247	0,06			
	208	0,05			
	412	0,11			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 371.228 \$)			361.536	97,01	
Kontrakte (in Tsd.)					
Gekaufte Optionen – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,20 %)					
			–		–
			2		–
			25		0,01
			2.530		–
			4		–
			2.890		0,01
			3.604		–
			2.932		–
			Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 162 \$)	93	0,02
Credit Default Swaps – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,06 %)					
			–		–
			232		0,06
Devisenterminkontrakte – 0,40 % (28. Februar 2023: 0,20 %)					
			–		–
			1501		0,40
Futures – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,02 %)					
			–		–
			620		0,17
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			363982	97,66	
Kontrakte (in Tsd.)					
Verkaufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,01 %)					
			–		–
			–9		–
			–2.890		–
			Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -25 \$)	-17	–
Zinsswaps – -0,07 % (28. Februar 2023: 0,28 %)					
			–		–
			-286		-0,07

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Devisenterminkontrakte – -0,11 % (28. Februar 2023: 1,08 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-403	-0,11
Futures – -0,07 % (28. Februar 2023: 0,32 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-253	-0,07
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-959	-0,25
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	363.023	97,41
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	9.658	2,59
Gesamtvermögen	372.681 \$	100,00

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 225.257.000 USD und machten 60,43 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.
- † Nicht liquide.
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- ε Das Wertpapier ist zum 29. Februar 2024 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).
- β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeits- datum	Nominal- betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.HY.CDSI 5 Year, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	1609	\$ 101
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	6375	131
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 155 \$)				\$ 232
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 155 \$)				\$ 232

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeits- datum	Nominal- betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum MXN TIIE Banxico, erhält festen Zinssatz von 7,450 %	18. Juli 2029	80.214	\$ -256
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 10,262 %	2. Jan. 2029	23.600	-30
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): - \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -756 \$)				-286
Nettowertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -756 \$)				\$ -286

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ minderung von Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2024	Citi	Kauf EUR	Verkauf USD 1.139	\$ -4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf CAD 177	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR 2.858	3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf GBP 2.821	-7
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf GBP 183	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD 45	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD	Verkauf USD 23.213	-64
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CHF	Verkauf USD 3.928	-81
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD 58.180	318
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD 214.126	933
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD 445	-2
19. Apr. 2024	BNP Paribas	Kauf USD	Verkauf CNH 504	–
19. Apr. 2024	BNP Paribas	Kauf USD	Verkauf NOK –	–
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD	Verkauf EUR 7.346	126
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD	Verkauf EUR 1.688	-6
19. Apr. 2024	Citi	Kauf USD	Verkauf GBP 6.505	63
19. Apr. 2024	Citi	Kauf AUD	Verkauf USD 10.832	-211
19. Apr. 2024	Citi	Kauf EUR	Verkauf USD 760	3
19. Apr. 2024	Citi	Kauf IDR	Verkauf USD 20.541.920	-4

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)		
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.232	Verkauf	CHF	1.070	15
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD	793	Verkauf	EUR	730	3
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	CHF	660	Verkauf	USD	750	1
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	USD	1.378	Verkauf	CNH	9.800	13
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	USD	1.356	Verkauf	IDR	20.995.354	22
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	MXN	1.590	Verkauf	USD	93	-
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	MXN	3.230	Verkauf	USD	188	-
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	USD	74	Verkauf	CAD	100	-
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.414	Verkauf	MXN	24.288	1
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	BRL	8.355	Verkauf	USD	1.690	-18
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	CAD	50	Verkauf	USD	37	-1
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	JPY	16.589	Verkauf	USD	116	-5
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 536 \$)							\$	1.501
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.965 \$)								-403
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.429 \$)							\$	1.098

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-91	\$ -21.532	\$ 118
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	49	11.699	-142
3 Month SOFR Index März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-22	-5.208	-6
Australia 10 Year Bond März 2024	Bank of America Merrill Lynch	20	1.495	17
Euro-Bund März 2024	Bank of America Merrill Lynch	81	11.613	-81
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Bank of America Merrill Lynch	-1	-144	-3
ICE 3 Month SONIA Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	37	11.067	107
ICE 3 Month SONIA Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	1	301	2
ICE 3 Month SONIA Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	38	11.390	71
Long Gilt Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	26	3.219	21
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	358	39.537	92
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	23	2.626	10
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	246	50.369	-21
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	130	13.898	14
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	26	3.100	23
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	142	18.158	145
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 53 \$)				\$ 620
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -890 \$)				-253
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -837 \$)				\$ 367

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert				
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 15,66 % (28. Februar 2023: 12,60 %)									
1.190	Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class M5, 5,423 %, fällig am 25.04.2035 *	1.213	0,23	2.722	Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class B, 144A, 3,821 %, fällig am 28.02.2033	2.470	0,47		
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Series 1996 1, Class B1, 7,875 %, fällig am 10.10.2026	47	0,01	3.365	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Series 2005 9XS, Class M2, 6,410 %, fällig am 25.06.2035 *	3.374	0,64		
601	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Class 1A2, 7,331 %, fällig am 28.08.2047	509	0,10	1.304	Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1, Series 2005 SC1, Class 1A1, 144A, 5,705 %, fällig am 25.05.2031 *	962	0,18		
1.244	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Class 1A3, 7,719 %, fällig am 28.08.2047	347	0,07	2.289	Sunnova Sol Issuer LLC, Series 2020 1A, Class B, 144A, 5,540 %, fällig am 01.02.2055	1.956	0,37		
62	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Series 2005 CL1, Class A1, 3,586 %, fällig am 25.09.2034 *	60	0,01	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 104.532 \$)			82.394	15,66	
2.801	Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Series 2016 1A, Class B, 144A, 5,682 %, fällig am 16.12.2041	2.461	0,47	Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 74,61 % (28. Februar 2023: 80,10 %)					
5.526	Conseco Finance Securitizations Corp, Series 2000 3, Class A, 144A, 8,260 %, fällig am 01.12.2030 *	1.283	0,24	5.919	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class F, 144A, 8,449 %, fällig am 15.09.2034 *	5.375	1,02		
793	Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2007 SD1, Class A1, 144A, 6,335 %, fällig am 25.03.2047 *	601	0,12	436	Alternative Loan Trust 2005-56, Series 2005 56, Class 4A1, 6,055 %, fällig am 25.11.2035 *	382	0,07		
599	Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Series 2007 MX1, Class A4, 144A, 6,231 %, fällig am 25.12.2036	595	0,11	1.085	Alternative Loan Trust 2005-80CB, Series 2005 80CB, Class 2A1, 6,000 %, fällig am 25.02.2036	1.011	0,19		
1.888	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, Series 2004 9, Class MF2, 5,572 %, fällig am 25.11.2034 *	1.767	0,34	2.068	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A14, 6,000 %, fällig am 25.08.2036	1.194	0,23		
1.401	Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Series 2018 1, Class D, 144A, 6,390 %, fällig am 20.07.2038	1.153	0,22	526	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A15, 6,000 %, fällig am 25.08.2036	304	0,06		
2.897	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Series 2018 2, Class D, 144A, 5,910 %, fällig am 20.12.2038	2.113	0,40	539	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A16, 6,000 %, fällig am 25.08.2036	311	0,06		
2.780	Eagle RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 10,522 %, fällig am 26.09.2033 *	2.898	0,55	610	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A20, 4,588 %, fällig am 25.08.2036 *	417	0,08		
4.869	Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 2005-2, Series 2005 2, Class M3, 6,215 %, fällig am 25.12.2035 *	4.241	0,81	590	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A24, 6,000 %, fällig am 25.08.2036	340	0,06		
1.995	FOCUS Brands Funding, Series 2023 2, Class A2, 144A, 8,241 %, fällig am 30.10.2053	2.115	0,40	750	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A3, 6,000 %, fällig am 25.08.2036 *	436	0,08		
6.435	Fremont Home Loan Trust 2006-B, Series 2006 B, Class 1A, 5,735 %, fällig am 25.08.2036 *	2.553	0,49	80	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A7, 6,000 %, fällig am 25.08.2036	46	0,01		
2.281	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Series 2021 4GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig am 20.07.2048	1.656	0,32	357	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A8, 6,000 %, fällig am 25.08.2036	206	0,04		
2.868	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-1, Series 2022 1GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig am 20.01.2049	1.890	0,36	4.608	Alternative Loan Trust 2006-28CB, Series 2006 28CB, Class A12, 0,465 %, fällig am 25.10.2036 *†	465	0,09		
2.483	HERO Funding Trust 2016-1, Series 2016 1A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig am 20.09.2041	323	0,06	926	Alternative Loan Trust 2007-23CB, Series 2007 23CB, Class A8, 6,658 %, fällig am 25.09.2037 *	740	0,14		
3.318	Home Partners of America 2021-2 Trust, Series 2021 2, Class F, 144A, 3,799 %, fällig am 17.12.2026	2.955	0,56	6.235	Alternative Loan Trust 2007-5CB, Series 2007 5CB, Class 1A20, 0,025 %, fällig am 25.04.2037 *†	541	0,10		
1.770	Home RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 11,322 %, fällig am 25.10.2033 *	1.885	0,36	2.475	BAMLI Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Series 2016 GG10, Class AJA, 144A, 5,630 %, fällig am 10.08.2045 *	531	0,10		
1.440	Jack in the Box Funding LLC, Series 2022 1A, Class A21, 144A, 3,445 %, fällig am 26.02.2052	1.335	0,25	4.208	Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Series 2015 R4, Class 4A3, 144A, 7,231 %, fällig am 27.01.2030 *	1.460	0,28		
1.312	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Series 2021 1GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig am 20.01.2048	823	0,16	6.000	BBCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class F, 144A, 4,563 %, fällig am 10.08.2033 *	3.889	0,74		
2.231	Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Series 2021 2GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig am 20.03.2048	1.378	0,26	5.279	BCAP LLC 2014-RR2, Series 2014 RR2, Class 10A2, 144A, 4,095 %, fällig am 26.07.2046 *	4.278	0,81		
1.130	Loanpal Solar Loan Ltd, Series 2020 3GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig am 20.12.2047	684	0,13	765	BCAP LLC Trust 2007-AA3, Series 2007 AA3, Class 1A2, 5,975 %, fällig am 25.04.2037 *	1.042	0,20		
30	Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, Series 2002 2, Class M2, 5,897 %, fällig am 25.07.2032 *	28	0,01	1.207	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Series 2004 AC6, Class A1, 5,750 %, fällig am 25.11.2034	1.017	0,19		
4.598	Magnolia Finance, 8,552 %, fällig am 09.08.2024	4.589	0,87	10.010	BHMS 2018-MZB, Series 2018 MZB, Class MZB, 144A, 12,251 %, fällig am 15.07.2025 *	9.172	1,74		
68	Mastr Specialized Loan Trust, Series 2006 2, Class A, 144A, 5,955 %, fällig am 25.02.2036 *	65	0,01	3.500	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Series 2024 NQM2, Class M1, 144A, 6,819 %, fällig am 25.02.2064	3.517	0,67		
3	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Series 2003-SD1, Series 2003 SD1, Class A1, 6,435 %, fällig am 25.03.2033 *	3	-	3.500	BX Trust 2018-GW MZ, Series 2018 GWMZ, Class MC, 144A, 11,103 %, fällig am 15.05.2037 *	3.478	0,66		
1.221	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Series 2018 1A, Class CERT, 144A, 0,000 %, fällig am 22.06.2043 ∞	446	0,09	1.750	BX Trust 2018-GW, Series 2018 GW, Class G, 144A, 8,535 %, fällig am 15.05.2035 *	1.725	0,33		
1.500	Mosaic Solar Loan Trust 2024-1, Series 2024 1, Class B, 144A, 6,250 %, fällig am 20.09.2049	1.483	0,28	870	BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class E, 144A, 9,032 %, fällig am 15.06.2036 *	808	0,15		
3.000	National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15, Class AR15, 0,000 %, fällig am 01.06.2045	275	0,05	3.327	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-A1, Series 2007 A1, Class 11M1, 4,321 %, fällig am 25.03.2037 *	3.041	0,58		
7.796	National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class B, 5,935 %, fällig am 27.07.2037 *	5.843	1,11	832	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2004-4, Series 2004 4A, Class B1, 144A, 4,628 %, fällig am 25.10.2035 *	630	0,12		
5.987	National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A5, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig am 25.03.2038 *	1.331	0,25	252	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-1, Series 2005 1A, Class A2, 144A, 5,635 %, fällig am 25.01.2036 *	223	0,04		
6.140	National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig am 25.03.2038 *	1.283	0,24	383	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-B, Series 2005 BA, Class B1, 144A, 5,835 %, fällig am 25.06.2036 *	313	0,06		
2.209	NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, Series 2021 FHT1, Class A, 144A, 3,104 %, fällig am 25.07.2026	2.058	0,39	391	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25, Series 2004 25, Class 2A1, 6,115 %, fällig am 25.02.2035 *	325	0,06		
2.549	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M2, 6,217 %, fällig am 25.04.2035	2.012	0,38	338	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Series 2005 11, Class 3A3, 3,738 %, fällig am 25.04.2035 *	224	0,04		
2.213	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Series 2005 5, Class MV2, 3,237 %, fällig am 25.11.2035 *	1.954	0,37	214	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, Series 2005 25, Class A15, 2,685 %, fällig am 25.11.2035 *	125	0,02		
12.260	Redwood Funding Trust 2019-1, Series 2019 1, Class PT, 144A, 4,968 %, fällig am 27.09.2024	11.957	2,27	750	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-3, Series 2007 3, Class 1A4, 6,000 %, fällig am 25.04.2037	684	0,13		
1.800	Sesac Finance LLC, Series 2024 1, Class A2, 144A, 6,421 %, fällig am 25.01.2054	1.807	0,34	2.990	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Series 2014 GC23, Class C, 4,420 %, fällig am 10.07.2047 *	2.833	0,54		
120	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, Series 2017 F, Class R1, 144A, 0,000 %, fällig am 25.01.2041	1.146	0,22	3.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Series 2015 GC29, Class D, 144A, 3,110 %, fällig am 10.04.2048	2.530	0,48		
-	Southern Pacific Secured Assets Corp, Series 1998 1, Class A7, 6,510 %, fällig am 25.12.2027 *	-	-	3.125	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1, Series 2015 P1, Class D, 144A, 3,225 %, fällig am 15.09.2048	2.685	0,51		
513	Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class A, 144A, 2,675 %, fällig am 28.02.2033	467	0,09	9.200	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 2A4, 5,875 %, fällig am 25.09.2036 *	2.688	0,51		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
766			2.498		
Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Series 2008 3, Class A3, 144A, 6,100 %, fällig am 25.04.2037					
3.529	345	0,07	2.533	2.834	0,54
Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-J2, Series 2014 J2, Class B5, 144A, 3,818 %, fällig am 25.11.2044 *					
3.250	2.224	0,42	5.453	2.931	0,56
COLT 2021-RPL1 Trust, Series 2021 RPL1, Class B1, 144A, 4,692 %, fällig am 25.09.2061 *					
4.745	2.560	0,49	3.925	6.065	1,15
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 9,536 %, fällig am 25.07.2039 *					
8.245	4.941	0,94	6.215	4.711	0,90
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 8,836 %, fällig am 25.10.2039 *					
5.760	8.516	1,62	6.000	4.896	0,93
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 8,422 %, fällig am 25.10.2041 *					
1.500	5.896	1,12	8.000	6.416	1,22
CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C3, Class C, 4,350 %, fällig am 15.08.2048 *					
259	1.259	0,24	1.640	8.513	1,62
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-AR5, Series 2004 AR5, Class CB2, 4,857 %, fällig am 25.06.2034 *					
9.700	204	0,04	530	1.861	0,35
CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class E, 144A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037					
9.200	5.176	0,98	5.020	574	0,11
CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037					
4.373	4.040	0,77	3.995	5.377	1,02
CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B1, 144A, 2,969 %, fällig am 25.07.2057 *					
5.017	2.935	0,56	5.874	2.545	0,48
CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B2, 144A, 2,969 %, fällig am 25.07.2057 *					
4.266	2.972	0,56	5.874	4.053	0,77
CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B3, 144A, 2,969 %, fällig am 25.07.2057 *					
4.296	1.885	0,36	6.841	5.019	0,95
CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B4, 144A, 2,969 %, fällig am 25.07.2057 *					
2.060	820	0,16	3.000	3.504	0,67
CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Class B3, 144A, 4,535 %, fällig am 01.08.2057 *					
5.559	1.947	0,37	4.620	5.805	1,10
CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Class B4, 144A, 4,535 %, fällig am 01.08.2057 *					
7.854	5.117	0,97	3.100	3.580	0,68
CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Series 2006 7, Class 11A2, 1,065 %, fällig am 25.08.2036 *†					
96	1.025	0,19	5.550	6.141	1,17
CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Series 2006 1R, Class 1A2, 144A, 4,569 %, fällig am 27.07.2036 *					
4.362	88	0,02	4.000	4.218	0,80
CSMC Series 2015-2R, Series 2015 2R, Class 7A2, 144A, 4,493 %, fällig am 27.08.2036 *					
4.307	3.296	0,63	24.919	11.833	2,25
CSMC Trust 2013-IVR5, Series 2013 IVR5, Class B5, 144A, 3,622 %, fällig am 25.10.2043 *					
2.000	2.866	0,54	707	–	–
CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144A, 12,794 %, fällig am 15.07.2032 *					
1.941	1.707	0,32	1.777	–	–
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class AX1, 144A, 0,083 %, fällig am 25.02.2048 *					
–	7	–	147	–	–
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class SA, 144A, 0,000 %, fällig am 25.02.2048					
4.000	–	–	12.430	–	–
CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Class H, 144A, 8,977 %, fällig am 15.08.2035 *					
2.325	3.651	0,69	7.899	123	0,02
DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Series 2017 BBG, Class A, 144A, 8,500 %, fällig am 15.06.2034 *					
572	2.325	0,44	2.903	41	0,01
DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Series 2004 AR4, Class 2A2B, 6,274 %, fällig am 19.01.2045 *					
1.267	383	0,07	5.181	65	0,01
DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Series 2005 AR3, Class 2A1B, 5,914 %, fällig am 19.07.2045 *					
2.313	1.169	0,22	7.112	58	0,01
DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Series 2005 AR5, Class 2A1B, 6,114 %, fällig am 19.09.2045 *					
460	1.517	0,29	657	2	–
DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 2A1B, 5,614 %, fällig am 19.04.2047 *					
5.320	492	0,09	3.496	86	0,02
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C01, Class 1B, 17,186 %, fällig am 25.08.2028 *					
3.660	6.122	1,16	666	90	0,02
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C02, Class 1B, 17,686 %, fällig am 25.09.2028 *					
2.929	4.284	0,81	631	68	0,01
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C03, Class 1B, 17,186 %, fällig am 25.10.2028 *					
4.873	3.412	0,65	3.140	294	0,06
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C04, Class 1B, 15,686 %, fällig am 25.01.2029 *					
7.158	5.559	1,06	4.524	2.588	0,49
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C06, Class 1B, 14,686 %, fällig am 25.04.2029 *					
3.875	8.086	1,54	2.666	1.545	0,29
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C06, Class 1B1, 9,186 %, fällig am 25.03.2031 *					
1.504	4.166	0,79	25.528	3.312	0,63
Fannie Mae REMICS, Series 2017 85, Class SC, 0,764 %, fällig am 25.11.2047 *					
3	135	0,03	1.250	888	0,17
First Franklin Mortgage Loan Trust 2002-FF1, Series 2002 FF1, Class 1A2, 6,568 %, fällig am 25.04.2032 *					
3.590	3	–	3.200	2.891	0,55
Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 8,672 %, fällig am 25.07.2041 *					
6.605	3.172	0,60	2.500	1.943	0,37
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038, Class X3, 2,411 %, fällig am 25.06.2042 *					
19.370	16	–	1.500	1.308	0,25
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Class X3, 1,616 %, fällig am 25.01.2044 *					
12.600	514	0,10	4.846	500	0,10
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 162, Class X1, 0,370 %, fällig am 25.12.2033 *					
3.484	406	0,08	72	68	0,01
Freddie Mac REMICS 5152, Class IO, 2,500 %, fällig am 25.10.2051					
4.914	557	0,11			
Freddie Mac STACR Debt Notes 2016-DNA1, Series 2016 DNA1, Class B, 15,436 %, fällig am 25.07.2028 *					
	5.487	1,04			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
44			3.000		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class 2A1A, 5,974 %, fällig am 19.03.2035 *					
	43	0,01		2.419	0,46
119			3.355		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10, Series 2005 10, Class 2A1A, 6,054 %, fällig am 19.11.2035 *					
	79	0,02		3.019	0,57
403			3.000		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 2A1A, 5,874 %, fällig am 19.05.2035 *					
	362	0,07		2.254	0,43
172			487		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 2A1A, 5,914 %, fällig am 19.06.2035 *					
	162	0,03		1.114	0,21
1.686			2.728		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Series 2005 8, Class 2A2, 6,581 %, fällig am 19.09.2035 *					
	1.429	0,27		2.725	0,52
413			3.000		
HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Class 2A1A, 5,809 %, fällig am 19.11.2036 *					
	355	0,07		2.981	0,57
500			579		
HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class E, 144A, 8,386 %, fällig am 16.06.2036 *					
	466	0,09		365	0,07
686			927		
Impac CMB Trust Series 2005-1, Series 2005 1, Class M1, 6,125 %, fällig am 25.04.2035 *					
	625	0,12		851	0,16
1.500			3.289		
Impac CMB Trust Series 2005-3, Series 2005 3, Class A2, 6,035 %, fällig am 25.08.2035 *					
	1.332	0,25		2.579	0,49
567			12.867		
Impac CMB Trust Series 2005-4, Series 2005 4, Class 1M1, 6,080 %, fällig am 25.05.2035 *					
	511	0,10		2.368	0,45
922			18.836		
Impac CMB Trust Series 2005-7, Series 2005 7, Class A1, 5,955 %, fällig am 25.11.2035 *					
	808	0,15		3.312	0,63
1.268			4.393		
Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Class 2B, 6,535 %, fällig am 25.08.2036 *					
	1.256	0,24		463	0,09
15			7.637		
Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Class 2M3, 6,535 %, fällig am 25.08.2036 *					
	15	-		876	0,17
618			3.222		
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Series 2005 AR13, Class 1A1, 4,065 %, fällig am 25.08.2035 *					
	303	0,06		2.894	0,55
553			49.006		
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Series 2005 AR2, Class 2A1B, 6,215 %, fällig am 25.02.2035 *					
	389	0,07		198	0,04
1.782			2.319		
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Series 2005 AR6, Class 2A2, 6,095 %, fällig am 25.04.2035 *					
	1.302	0,25		2.226	0,42
28.545			11.418		
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 0,000 %, fällig am 15.06.2035 t _e					
	358	0,07		4.014	0,76
2.282			15.971		
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class E, 144A, 9,464 %, fällig am 15.10.2032 *					
	2.265	0,43		5.598	1,06
2.250			650		
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class F, 144A, 10,764 %, fällig am 15.10.2032 *					
	2.195	0,42		26	0,01
4.022			14.332		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Series 2015 FL7, Class D, 144A, 9,193 %, fällig am 15.05.2028 *					
	3.506	0,67		66	0,01
3.600			295		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Series 2015 JP1, Class C, 4,723 %, fällig am 15.01.2049 *					
	3.197	0,61		265	0,05
1.800			48		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class GFL, 144A, 8,963 %, fällig am 05.07.2033 *					
	1.118	0,21		40	0,01
6.574			3.900		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class G, 144A, 10,182 %, fällig am 15.12.2036 *					
	497	0,09		3.139	0,60
6.867			7.118		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class H, 144A, 12,682 %, fällig am 15.12.2036 *					
	376	0,07		4.896	0,93
4.000			4.000		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2021-NYMZ, Series 2021 NYMZ, Class M, 144A, 12,682 %, fällig am 15.06.2026 *					
	3.141	0,60		3.816	0,73
9.110			3.069		
JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Class AX1, 144A, 0,214 %, fällig am 25.10.2048 *†					
	60	0,01		3.055	0,58
5.420			2.770		
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, Series 2014 C25, Class D, 144A, 3,932 %, fällig am 15.11.2047 *					
	3.344	0,64		2.759	0,52
11			2.750		
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, Series 2004 15, Class 6A1, 5,765 %, fällig am 25.12.2034 *					
	10	-		2.757	0,52
1.464			3.289		
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Series 2004 6, Class B1, 5,495 %, fällig am 25.07.2034 *					
	1.339	0,25		2.666	0,51
1.179			1.343		
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Series 2004 8, Class B1, 5,451 %, fällig am 25.09.2034 *					
	1.040	0,20		799	0,15
661			2.500		
MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class 1A1, 144A, 6,000 %, fällig am 25.08.2034 *					
	416	0,08		1.161	0,22
808			1.252		
MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 1A1F, 144A, 5,785 %, fällig am 25.05.2035 *					
	420	0,08		2.096	0,40
5.000			1.252		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Series 2016 C32, Class D, 144A, 3,396 %, fällig am 15.12.2049 *					
	3.187	0,61		645	0,12
3.742			Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 533.126 \$)		
	3.042	0,58		392.587	74,61
1.361			Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 1,23 % (28. Februar 2023: 0,48 %)		
USA – 1,23 % (28. Februar 2023: 0,48 %)					
3.304			1.200		
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Series 2004 11AR, Class 1B1, 6,035 %, fällig am 25.01.2035 *					
	1.090	0,21		1.228	0,23
3.304			1.550		
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-BAR, Series 2006 BAR, Class 1A3, 5,755 %, fällig am 25.06.2036 *					
	671	0,13		1.455	0,28
508			4.000		
Multifamily Trust 2016-1, Series 2016 1, Class B, 144A, 4,323 %, fällig am 25.04.2046 *					
	506	0,10		3.780	0,72
5.308				6.463	1,23
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,398 %, fällig am 15.08.2036 *					
	3.339	0,63			
4.870			Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.311 \$)		
	2.576	0,49		6.463	1,23

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Schuldscheindarlehen – 3,13 % (28. Februar 2023: 3,29 %)		
30.000 American Dream, 0,000 %, fällig am 29.06.2024 *†∞	1.102	0,21
1.613 Freehand Hotel, 9,523 %, fällig am 17.12.2024 *∞	1.589	0,30
2.935 Freehand Hotel, 9,523 %, fällig am 17.12.2024 *∞	2.891	0,55
5.452 Freehand Hotel, 9,523 %, fällig am 17.12.2024 *∞	5.372	1,02
5.551 Sono Retail Loan, 8,702 %, fällig am 06.06.2024 *∞	5.524	1,05
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 45.457 \$)	16.478	3,13
Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,09 % (28. Februar 2023: 3,08 %)		
21.501 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	21.501	4,09
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 21.501 \$)	21.501	4,09
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 710.927 \$)		
	519.423	98,72
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	12	–
Futures – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,05 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	166	0,03
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	519.601	98,75
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: -0,30 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-6	–
Futures – -0,06 % (28. Februar 2023: 0,01 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-306	-0,06
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-312	-0,06
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	519.289	98,69
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	6.867	1,31
Gesamtnettovermögen	526.156 \$	100,00

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 319.582.000 USD und machten 60,72 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.
- † Nicht liquide.
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- ε Das Wertpapier ist zum 29. Februar 2024 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	91,27
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	3,12
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,08
Finanzderivate	0,03
Sonstige Vermögenswerte	1,50
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 260	Verkauf CHF 228	\$ 2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 121	Verkauf EUR 110	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 77	Verkauf EUR 71	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1.825	Verkauf USD 1.965	10
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CHF 291	Verkauf USD 337	-6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 8 \$)				\$ 12
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.683 \$)				-6
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.675 \$)				\$ 6

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	-206	\$ -49.183	\$ 80
3 Month SOFR Index Dezember 2025	Bank of America Merrill Lynch	213	51.272	-203
3 Month SOFR Index September 2024	Bank of America Merrill Lynch	-204	-48.544	86
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-42	-4.638	-9
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-84	-9.591	-39
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-4	-428	-1
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	-112	-13.356	-54
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 317 \$)				\$ 166
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -73 \$)				-306
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 244 \$)				\$ -140

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 1,44 % (28. Februar 2023: 1,53 %)					
1.202 DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig am 20.11.2051	1.006	0,09	6	6	–
1.357 FOCUS Brands Funding, Series 2023 2, Class A2, 144A, 8,241 %, fällig am 30.10.2053	1.438	0,13	7	7	–
4.764 Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Series 2023 3C, Class A, 144A, 6,500 %, fällig am 20.07.2055	4.895	0,43	75	76	0,01
2.658 Home Partners of America 2021-3 Trust, Series 2021 3, Class A, 144A, 2,200 %, fällig am 17.01.2041	2.319	0,20	19	19	–
2.129 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Series 2021 2GS, Class B, 144A, 2,790 %, fällig am 20.03.2048	1.564	0,14	513	498	0,04
525 SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 10B, Class 1, 3,548 %, fällig am 10.09.2028	495	0,04	14	15	–
1.981 SBA Small Business Investment Cos, Series 2023 10A, Class 1, 5,168 %, fällig am 10.03.2033	1.965	0,17	3	3	–
2.310 SBA Small Business Investment Cos, Series 2023 10B, Class 1, 5,688 %, fällig am 10.09.2033	2.348	0,20	1	1	–
500 SMB Private Education Loan Trust 2023-C, Series 2023 C, Class B, 144A, 6,360 %, fällig am 15.11.2052	502	0,04	14	14	–
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 17.407 \$)	16.532	1,44	4	4	–
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 98,31 % (28. Februar 2023: 98,53 %)					
53.715 BANK 2017-BNK8, Series 2017 BNK8, Class XA, 0,710 %, fällig am 15.11.2050 *	1.133	0,10	6	6	–
2.400 BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Class A5, 3,688 %, fällig am 15.02.2061	2.266	0,20	7	7	–
2.210 Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Class A5, 3,666 %, fällig am 15.01.2051 *	2.053	0,18	75	76	0,01
4.050 BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class A, 144A, 6,865 %, fällig am 15.07.2035 *	4.039	0,35	19	19	–
995 BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Class A, 144A, 6,336 %, fällig am 15.02.2038 *	953	0,08	513	498	0,04
1.000 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Series 2017 P8, Class A3, 3,203 %, fällig am 15.09.2050	933	0,08	14	15	–
1.470 COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Series 2015 PC1, Class A5, 3,902 %, fällig am 10.07.2050	1.437	0,13	5	5	–
1.950 CSMC 2021-NQM8, Series 2021 NQM8, Class A1, 144A, 1,841 %, fällig am 25.10.2066 *	1.671	0,15	5	5	–
2.325 DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Series 2017 BBG, Class A, 144A, 8,500 %, fällig am 15.06.2034 *	2.325	0,20	10	10	–
1.082 Fannie Mae Interest Strip 406, Class 2, 4,000 %, fällig am 25.02.2041	180	0,02	20	20	–
256 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 9, 5,000 %, fällig am 25.02.2041 *	41	–	26	26	–
540 Fannie Mae Interest Strip 407, Class C10, 5,000 %, fällig am 25.01.2038	87	0,01	80	80	0,01
359 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig am 25.11.2041	54	–	78	78	–
2.015 Fannie Mae Interest Strip 417, Class C5, 3,500 %, fällig am 25.02.2043	337	0,03	445	470	0,04
4.726 Fannie Mae Interest Strip 418, Class C15, 3,500 %, fällig am 25.08.2043	786	0,07	211	211	–
1.645 Fannie Mae Interest Strip 427, Class C21, 2,000 %, fällig am 25.03.2050	214	0,02	3.359	3.061	0,27
16.173 Fannie Mae Interest Strip 427, Class C73, 3,000 %, fällig am 25.12.2048	2.592	0,23	29	27	–
906 Fannie Mae Interest Strip 428, Class C14, 2,500 %, fällig am 25.01.2048	105	0,01	1.160	1.206	0,10
1.796 Fannie Mae Interest Strip 429, Class C10, 1,500 %, fällig am 25.04.2037	101	0,01	106	102	0,01
3.747 Fannie Mae Interest Strip 435, Class C28, 3,500 %, fällig am 25.09.2052	687	0,06	4.395	4.184	0,36
2.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	1.711	0,15	794	748	0,07
3.900 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	3.693	0,32	787	728	0,06
2.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	1.893	0,16	92	85	0,01
3.800 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,000 % ±	3.816	0,33	93	88	0,01
– Fannie Mae Pool '252875', 8,000 %, fällig am 01.11.2029	–	–	318	300	0,03
– Fannie Mae Pool '253184', 8,000 %, fällig am 01.04.2030	–	–	892	849	0,07
– Fannie Mae Pool '253399', 8,500 %, fällig am 01.08.2030	–	–	58	55	–
– Fannie Mae Pool '253438', 8,500 %, fällig am 01.09.2030	–	–	223	212	0,02
– Fannie Mae Pool '253598', 8,500 %, fällig am 01.12.2030	–	–	276	244	0,02
– Fannie Mae Pool '535270', 8,500 %, fällig am 01.04.2030	–	–	272	258	0,02
6 Fannie Mae Pool '535299', 7,500 %, fällig am 01.05.2030	6	–	41	39	–
1 Fannie Mae Pool '535332', 8,500 %, fällig am 01.04.2030	1	–	120	114	0,01
– Fannie Mae Pool '535351', 8,000 %, fällig am 01.06.2030	–	–	124	118	0,01
– Fannie Mae Pool '535435', 8,500 %, fällig am 01.08.2030	–	–	83	73	0,01
– Fannie Mae Pool '535608', 9,500 %, fällig am 01.04.2030	–	–	275	244	0,02
3 Fannie Mae Pool '535996', 7,500 %, fällig am 01.06.2031	3	–	140	124	0,01
– Fannie Mae Pool '537715', 8,500 %, fällig am 01.09.2030	–	–	328	291	0,03
17 Fannie Mae Pool '545189', 7,500 %, fällig am 01.08.2031	17	–	491	467	0,04
14 Fannie Mae Pool '545190', 7,500 %, fällig am 01.08.2031	14	–	171	165	0,01
1 Fannie Mae Pool '545612', 8,000 %, fällig am 01.04.2032	1	–	97	92	0,01
1 Fannie Mae Pool '545990', 7,500 %, fällig am 01.04.2031	1	–	3.146	2.965	0,26
– Fannie Mae Pool '546591', 8,500 %, fällig am 01.06.2030	–	–	1.338	1.307	0,11
1 Fannie Mae Pool '548965', 8,500 %, fällig am 01.07.2030	1	–	380	346	0,03
8 Fannie Mae Pool '555676', 7,500 %, fällig am 01.12.2032	8	–	260	237	0,02
11 Fannie Mae Pool '745248', 7,500 %, fällig am 01.08.2034	11	–	211	191	0,02
100 Fannie Mae Pool '745802', 6,000 %, fällig am 01.07.2036	103	0,01	229	216	0,02
406 Fannie Mae Pool '836398', 6,915 %, fällig am 01.10.2035 *	414	0,04	148	143	0,01
			197	187	0,02
			2.956	2.707	0,24
			66	63	0,01
			25	24	–
			312	277	0,02
			69	67	–
			76	73	0,01
			102	99	0,01
			78	75	0,01
			21	20	–
			70	66	0,01
			158	149	0,01
			197	186	0,02
			269	254	0,02
			2.082	2.008	0,17
			2.383	2.129	0,19
			650	573	0,05
			1.812	1.812	0,16
			3.567	3.568	0,31
			862	803	0,07
			1.616	1.544	0,13
			1.064	953	0,08
			1.935	1.849	0,16
			664	630	0,05
			1.941	1.612	0,14
			175	164	0,01

[^] In Hong Kong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
5 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig am 06.01.2031	5	–	7.388 Fannie Mae REMICS, Series 2021 33, Class AI, 2,500 %, fällig am 25.05.2047	977	0,08
115 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig am 11.01.2031	114	0,01	1.959 Fannie Mae REMICS, Series 2021 4, Class GI, 3,000 %, fällig am 25.02.2051	327	0,03
132 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig am 12.01.2031	130	0,01	23.981 Fannie Mae REMICS, Series 2021 42, Class NI, 2,500 %, fällig am 25.11.2048	3.280	0,29
26 Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500 %, fällig am 12.01.2031	26	–	7.625 Fannie Mae REMICS, Series 2021 46, Class BI, 2,500 %, fällig am 25.12.2048	1.037	0,09
168 Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, fällig am 09.01.2042	153	0,01	7.248 Fannie Mae REMICS, Series 2021 49, Class GI, 2,500 %, fällig am 25.10.2048	943	0,08
10 Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500 %, fällig am 09.01.2042	10	–	4.982 Fannie Mae REMICS, Series 2021 52, Class CI, 2,500 %, fällig am 25.12.2047	681	0,06
41 Fannie Mae Pool 'MA1363', 3,000 %, fällig am 02.01.2043	36	–	1.115 Fannie Mae REMICS, Series 2021 54, Class KI, 2,500 %, fällig am 25.05.2049	146	0,01
1.280 Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000 %, fällig am 03.01.2043	1.229	0,11	8.932 Fannie Mae REMICS, Series 2021 59, Class TI, 2,500 %, fällig am 25.09.2051	1.324	0,12
287 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig am 09.01.2043	278	0,02	1.474 Fannie Mae REMICS, Series 2021 61, Class KI, 2,500 %, fällig am 25.04.2049	202	0,02
206 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, fällig am 10.01.2043	199	0,02	785 Fannie Mae REMICS, Series 2021 62, Class GI, 2,500 %, fällig am 25.10.2047	114	0,01
133 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, fällig am 11.01.2043	129	0,01	848 Fannie Mae REMICS, Series 2021 63, Class QI, 2,500 %, fällig am 25.06.2051	107	0,01
189 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, fällig am 12.01.2043	183	0,02	5.706 Fannie Mae REMICS, Series 2021 85, Class IN, 2,500 %, fällig am 25.02.2050	896	0,08
383 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig am 07.01.2036	353	0,03	2.428 Fannie Mae REMICS, Series 2021 89, Class AI, 2,500 %, fällig am 25.04.2048	358	0,03
372 Fannie Mae Pool 'MA2837', 3,000 %, fällig am 12.01.2036	342	0,03	12.466 Fannie Mae REMICS, Series 2021 91, Class IG, 2,500 %, fällig am 25.01.2052	1.800	0,16
217 Fannie Mae Pool 'MA4175', 1,500 %, fällig am 11.01.2040	175	0,02	11.600 Fannie Mae REMICS, Series 2022 29, Class KZ, 1,500 %, fällig am 25.06.2042	8.052	0,70
2.697 Fannie Mae Pool 'MA4181', 1,500 %, fällig am 11.01.2050	2.021	0,18	687 Fannie Mae REMICS, Series 2022 57, Class BC, 4,000 %, fällig am 25.09.2052	646	0,06
625 Fannie Mae Pool 'MA4204', 2,000 %, fällig am 12.01.2040	525	0,05	280 Fannie Mae-Aces, Series 2016 M11, Class AL, 2,944 %, fällig am 25.07.2039	249	0,02
5.291 Fannie Mae Pool 'MA4208', 2,000 %, fällig am 12.01.2050	4.186	0,36	15.261 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M11, Class X1, 1,184 %, fällig am 25.06.2029 *	641	0,06
449 Fannie Mae Pool 'MA4342', 1,500 %, fällig am 05.01.2041	360	0,03	14.693 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M13, Class X1, 0,826 %, fällig am 25.06.2034 *	559	0,05
718 Fannie Mae Pool 'MA4387', 2,000 %, fällig am 07.01.2041	601	0,05	37.266 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M14, Class X1, 0,557 %, fällig am 25.06.2029 *	862	0,07
1.325 Fannie Mae Pool 'MA4474', 2,000 %, fällig am 11.01.2041	1.106	0,10	4.842 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M11, Class IO, 1,767 %, fällig am 25.01.2029 *	322	0,03
1.276 Fannie Mae Pool 'MA4500', 1,500 %, fällig am 12.01.2041	1.024	0,09	33.589 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M16, Class X1, 0,462 %, fällig am 25.04.2032 *	837	0,07
2.108 Fannie Mae Pool 'MA4501', 2,000 %, fällig am 12.01.2041	1.759	0,15	4.433 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M24, Class X1, 1,594 %, fällig am 25.01.2037 *	393	0,03
513 Fannie Mae Pool 'MA4540', 3,000 %, fällig am 02.01.2042	428	0,04	15.141 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M31, Class X2, 1,231 %, fällig am 25.12.2032 *	854	0,07
2.682 Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000 %, fällig am 03.01.2042	2.236	0,19	34 Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000 %, fällig am 01.01.2035	34	–
4.061 Fannie Mae Pool 'MA4587', 2,500 %, fällig am 04.01.2042	3.512	0,31	9 Freddie Mac Gold Pool 'A30703', 5,500 %, fällig am 01.12.2034	9	–
797 Fannie Mae REMICS, Series 2010 2, Class AI, 5,500 %, fällig am 25.02.2040	126	0,01	85 Freddie Mac Gold Pool 'A35950', 5,000 %, fällig am 01.07.2035	84	0,01
860 Fannie Mae REMICS, Series 2012 124, Class SD, 0,714 %, fällig am 25.11.2042 *	96	0,01	10 Freddie Mac Gold Pool 'A36526', 5,000 %, fällig am 01.08.2035	10	–
1.189 Fannie Mae REMICS, Series 2012 22, Class SM, 1,064 %, fällig am 25.03.2042 *	136	0,01	36 Freddie Mac Gold Pool 'A39036', 5,000 %, fällig am 01.05.2035	35	–
542 Fannie Mae REMICS, Series 2012 9, Class PT, 11,502 %, fällig am 25.07.2036 *	640	0,06	– Freddie Mac Gold Pool 'A84166', 6,500 %, fällig am 01.01.2039	–	–
682 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, fällig am 25.07.2042	715	0,06	1 Freddie Mac Gold Pool 'C00556', 8,000 %, fällig am 01.10.2027	1	–
3.179 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5,500 %, fällig am 25.04.2042	3.225	0,28	– Freddie Mac Gold Pool 'C01025', 8,000 %, fällig am 01.07.2030	–	–
131 Fannie Mae REMICS, Series 2015 39, Class LZ, 3,000 %, fällig am 25.06.2045	115	0,01	– Freddie Mac Gold Pool 'C01051', 8,000 %, fällig am 01.09.2030	–	–
5.141 Fannie Mae REMICS, Series 2016 48, Class IA, 4,500 %, fällig am 25.06.2038	711	0,06	1 Freddie Mac Gold Pool 'C46047', 8,000 %, fällig am 01.12.2030	1	–
2.127 Fannie Mae REMICS, Series 2017 74, Class PZ, 3,500 %, fällig am 25.10.2047	1.671	0,15	3 Freddie Mac Gold Pool 'C55319', 8,000 %, fällig am 01.08.2031	3	–
3.355 Fannie Mae REMICS, Series 2018 3, Class IO, 4,000 %, fällig am 25.02.2048	658	0,06	– Freddie Mac Gold Pool 'C57324', 8,000 %, fällig am 01.09.2031	–	–
1.098 Fannie Mae REMICS, Series 2018 74, Class AB, 3,500 %, fällig am 25.10.2048	998	0,09	1 Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500 %, fällig am 01.05.2027	1	–
840 Fannie Mae REMICS, Series 2019 25, Class PI, 5,000 %, fällig am 25.05.2048	167	0,01	938 Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, fällig am 01.02.2038	858	0,07
3.618 Fannie Mae REMICS, Series 2019 38, Class SH, 0,591 %, fällig am 25.07.2049 *	366	0,03	– Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000 %, fällig am 01.09.2026	–	–
1.852 Fannie Mae REMICS, Series 2019 44, Class SM, 0,614 %, fällig am 25.08.2049 *	249	0,02	– Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000 %, fällig am 01.06.2027	–	–
1.955 Fannie Mae REMICS, Series 2019 45, Class BS, 0,614 %, fällig am 25.08.2049 *	208	0,02	– Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000 %, fällig am 01.11.2026	–	–
3.531 Fannie Mae REMICS, Series 2019 5, Class IO, 4,500 %, fällig am 25.03.2049	692	0,06	24 Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500 %, fällig am 01.08.2038	25	–
1.098 Fannie Mae REMICS, Series 2019 57, Class NS, 0,564 %, fällig am 25.10.2049 *	118	0,01	1 Freddie Mac Gold Pool 'G04947', 6,500 %, fällig am 01.04.2038	1	–
1.360 Fannie Mae REMICS, Series 2019 58, Class HS, 0,564 %, fällig am 25.10.2049 *	143	0,01	4 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig am 01.09.2039	4	–
2.833 Fannie Mae REMICS, Series 2019 59, Class SH, 0,564 %, fällig am 25.10.2049 *	320	0,03	86 Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000 %, fällig am 01.03.2039	92	0,01
1.173 Fannie Mae REMICS, Series 2020 26, Class SA, 0,514 %, fällig am 25.05.2050 *	123	0,01			
968 Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Class GZ, 2,000 %, fällig am 25.07.2050	555	0,05			
694 Fannie Mae REMICS, Series 2020 62, Class AI, 2,500 %, fällig am 25.09.2050	109	0,01			
1.581 Fannie Mae REMICS, Series 2020 62, Class BI, 2,000 %, fällig am 25.09.2050	206	0,02			
4.787 Fannie Mae REMICS, Series 2020 63, Class KI, 2,500 %, fällig am 25.09.2050	366	0,03			
2.337 Fannie Mae REMICS, Series 2020 67, Class IH, 2,000 %, fällig am 25.09.2050	305	0,03			
2.416 Fannie Mae REMICS, Series 2020 71, Class IA, 2,000 %, fällig am 25.03.2041	103	0,01			
147 Fannie Mae REMICS, Series 2020 74, Class EI, 2,500 %, fällig am 25.10.2050	24	–			
12.602 Fannie Mae REMICS, Series 2020 88, Class GI, 2,500 %, fällig am 25.12.2050	1.889	0,16			
1.020 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig am 25.12.2050	156	0,01			
8.422 Fannie Mae REMICS, Series 2020 91, Class IO, 2,500 %, fällig am 25.12.2050	1.267	0,11			
6.013 Fannie Mae REMICS, Series 2020 93, Class LI, 2,500 %, fällig am 25.01.2051	827	0,07			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
202	207	0,02	85.262	2.032	0,18
888	863	0,08	17.883	356	0,03
136	129	0,01	28.465	898	0,08
1.114	1.133	0,10	4.167	459	0,04
3.325	3.138	0,27	6.599	188	0,02
4.614	4.189	0,36	39.997	802	0,07
8.136	7.157	0,62	28.950	934	0,08
1	1	–	5.015	4.705	0,41
42	42	–	2.293	2.160	0,19
1	1	–	450	435	0,04
265	248	0,02	788	744	0,06
162	152	0,01	85	74	0,01
157	149	0,01	293	265	0,02
1.217	1.147	0,10	2.856	2.476	0,22
58	55	–	116	101	0,01
346	327	0,03	174	152	0,01
299	283	0,02	421	354	0,03
32	29	–	294	246	0,02
78	71	0,01	72	58	0,01
30	28	–	134	108	0,01
53	49	–	68	55	–
77	71	0,01	72	58	0,01
140	128	0,01	212	171	0,01
104	95	0,01	146	119	0,01
103	94	0,01	78	63	0,01
124	114	0,01	63	51	–
3.498	3.122	0,27	76	61	0,01
1.742	1.674	0,15	76	62	0,01
56.415	983	0,09	69	55	–
81.656	897	0,08	155	131	0,01
54.532	274	0,02	507	440	0,04
57.720	279	0,02	413	346	0,03
879	21	–	387	324	0,03
7.962	568	0,05	421	352	0,03
11.316	895	0,08	336	281	0,02
5.963	393	0,03	480	402	0,03
8.724	607	0,05	3.730	3.121	0,27
984	51	–	1.804	1.506	0,13
102.709	4.146	0,36	3.581	2.986	0,26
3.582	138	0,01	914	762	0,07
12.494	381	0,03	3.823	3.064	0,27
63.980	1.345	0,12	83	72	0,01
61.452	1.250	0,11	6.219	5.437	0,47
			246	206	0,02
			524	417	0,04
			636	505	0,04
			89	72	0,01
			820	651	0,06
			520	413	0,04
			3.180	2.659	0,23
			262	219	0,02
			166	142	0,01
			269	215	0,02
			2.402	2.414	0,21
			2.695	2.696	0,23
			5.679	5.513	0,48
			87	85	0,01
			1.939	1.943	0,17
			725	735	0,06
			157	160	0,01
			159	162	0,01
			183	186	0,02
			285	291	0,03
			3.264	3.328	0,29
			996	967	0,08
			1.125	982	0,09
			6.185	5.403	0,47
			354	294	0,03
			378	303	0,03
			5.374	4.512	0,39
			17.298	14.520	1,26
			1.703	1.420	0,12
			64	53	–
			421	349	0,03

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettowert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettowert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
21			70		
			460		
1			914		
2			2.222		
1			769		
1			930		
4			1.267		
1			89		
4			83		
6			498		
2			146		
1			80		
2			137		
8			83		
240			5.053		
108			712		
233			350		
1			2.008		
			72		
42			106		
280			144		
2			176		
266			161		
115			11.832		
140			50		
42			79		
223			159		
192			117		
1.532			90		
6			16		
8			123		
603			1.673		
92			37		
100			6.022		
51			210		
31			57		
36			267		
3			184		
76			190		
32			187		
12			88		
7			2.190		
405			118		
895			485		
662			11		
62			126		
1.899			466		
59			330		
492			3.277		
8.511			3.383		
1.945			192		
2.789			109		
266			77		
1.423			111		
1.281			108		
404			4.388		
274			3.745		
8.501			181		
651			1.809		
2.648			3.650		
977			2.263		
1.383			3.521		
293			27.620		
1.850			2.074		
2.076			703		
1.642			15.094		
200			741		
894			4.483		
2.900			4.387		
914			235		
			3.576		
			130		
			14.111		
			7.028		
			422		
			3.197		
			4.975		
			1.090		
			14.196		
			112		
			1.579		
			4.482		
			646		
			575		
			4.953		
			1.285		
			2.522		
			2.230		
			4.567		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert		
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)							
3.661	Ginnie Mae II Pool 'MA8725', 5,000 %, fällig am 20.03.2053	3.580	0,31	222	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig am 20.10.2050	31	–
2.059	Ginnie Mae II Pool 'MA8794', 2,000 %, fällig am 20.03.2053	1.678	0,15	677	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class YI, 2,500 %, fällig am 20.10.2050	88	0,01
96	Ginnie Mae II Pool 'MA8798', 4,000 %, fällig am 20.04.2053	89	0,01	4.065	Government National Mortgage Association, Series 2020 181, Class WI, 2,000 %, fällig am 20.12.2050	454	0,04
12.127	Ginnie Mae II Pool 'MA8800', 5,000 %, fällig am 20.04.2053	11.853	1,03	1.435	Government National Mortgage Association, Series 2020 187, Class MI, 3,000 %, fällig am 20.12.2050	248	0,02
23.101	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	22.965	2,00	3.878	Government National Mortgage Association, Series 2020 191, Class IX, 2,500 %, fällig am 20.12.2050	680	0,06
4.394	Ginnie Mae II Pool 'MA8878', 5,000 %, fällig am 20.05.2053	4.293	0,37	4.531	Government National Mortgage Association, Series 2020 36, Class GS, 0,666 %, fällig am 20.03.2050 *	586	0,05
999	Ginnie Mae II Pool 'MA9011', 2,500 %, fällig am 20.07.2053	847	0,07	478	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050	87	0,01
2.000	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	1.910	0,17	1.333	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050	243	0,02
2.000	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	1.987	0,17	921	Government National Mortgage Association, Series 2020 61, Class CI, 4,000 %, fällig am 20.03.2050	177	0,02
584	Government National Mortgage Association, Series 2004 81, Class SK, 0,764 %, fällig am 16.10.2034 *	22	–	809	Government National Mortgage Association, Series 2020 85, Class CI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050	141	0,01
1.011	Government National Mortgage Association, Series 2008 40, Class SC, 0,914 %, fällig am 16.05.2038 *	65	0,01	5.787	Government National Mortgage Association, Series 2020 H08, Class BI, 0,026 %, fällig am 01.04.2070 *	179	0,02
1.287	Government National Mortgage Association, Series 2008 79, Class ID, 1,366 %, fällig am 20.06.2035 *	72	0,01	1.271	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class FL, 6,613 %, fällig am 20.05.2070 *	1.270	0,11
194	Government National Mortgage Association, Series 2010 H02, Class FA, 6,131 %, fällig am 20.02.2060 *	193	0,02	148	Government National Mortgage Association, Series 2020 H12, Class F, 5,963 %, fällig am 20.07.2070 *	144	0,01
443	Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Class AF, 5,793 %, fällig am 20.10.2060 *	441	0,04	1.053	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FA, 5,913 %, fällig am 20.07.2070 *	1.023	0,09
163	Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Class FE, 5,813 %, fällig am 20.05.2059 *	162	0,01	28.167	Government National Mortgage Association, Series 2021 110, Class IO, 0,873 %, fällig am 16.11.2063 *	1.802	0,16
233	Government National Mortgage Association, Series 2010 H28, Class FE, 5,863 %, fällig am 20.12.2060 *	232	0,02	1.077	Government National Mortgage Association, Series 2021 14, Class AB, 1,340 %, fällig am 16.06.2063	804	0,07
596	Government National Mortgage Association, Series 2011 146, Class KS, 0,664 %, fällig am 16.11.2041 *	60	0,01	6.454	Government National Mortgage Association, Series 2021 156, Class IE, 2,500 %, fällig am 20.09.2051	1.077	0,09
807	Government National Mortgage Association, Series 2011 79, Class KS, 0,000 %, fällig am 20.05.2041 *	62	0,01	12.857	Government National Mortgage Association, Series 2021 158, Class IN, 2,500 %, fällig am 20.09.2051	1.741	0,15
1.759	Government National Mortgage Association, Series 2012 H21, Class FA, 5,963 %, fällig am 20.07.2062 *	1.752	0,15	3.474	Government National Mortgage Association, Series 2021 180, Class IO, 0,912 %, fällig am 16.11.2063 *	234	0,02
8.878	Government National Mortgage Association, Series 2013 93, Class SA, 0,764 %, fällig am 16.06.2043 *	1.033	0,09	15.794	Government National Mortgage Association, Series 2021 191, Class NI, 3,000 %, fällig am 20.10.2051	3.005	0,26
485	Government National Mortgage Association, Series 2014 118, Class HS, 0,766 %, fällig am 20.08.2044 *	55	–	2.765	Government National Mortgage Association, Series 2021 21, Class AH, 1,400 %, fällig am 16.06.2063	2.069	0,18
786	Government National Mortgage Association, Series 2014 2, Class CI, 4,500 %, fällig am 20.01.2044	163	0,01	7.191	Government National Mortgage Association, Series 2021 216, Class NI, 3,000 %, fällig am 20.12.2051	1.367	0,12
2.233	Government National Mortgage Association, Series 2014 60, Class SA, 0,664 %, fällig am 16.04.2044 *	209	0,02	1.812	Government National Mortgage Association, Series 2021 26, Class AI, 2,000 %, fällig am 20.02.2051	212	0,02
7.542	Government National Mortgage Association, Series 2015 136, Class IO, 0,374 %, fällig am 16.08.2055 *	97	0,01	871	Government National Mortgage Association, Series 2021 29, Class AG, 5,000 %, fällig am 20.02.2051	847	0,07
3.446	Government National Mortgage Association, Series 2015 177, Class MI, 5,000 %, fällig am 20.10.2044	685	0,06	49.048	Government National Mortgage Association, Series 2021 37, Class IO, 0,805 %, fällig am 16.01.2061 *	2.819	0,25
2.395	Government National Mortgage Association, Series 2015 20, Class PI, 3,500 %, fällig am 20.02.2045	390	0,03	6.307	Government National Mortgage Association, Series 2021 46, Class NI, 2,500 %, fällig am 20.03.2051	998	0,09
26.044	Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Class IO, 0,526 %, fällig am 16.02.2059 *	780	0,07	21.174	Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,112 %, fällig am 16.01.2061 *	1.635	0,14
1.738	Government National Mortgage Association, Series 2017 19, Class SE, 0,714 %, fällig am 16.02.2047 *	165	0,01	28.708	Government National Mortgage Association, Series 2021 60, Class IO, 0,826 %, fällig am 16.05.2063 *	1.678	0,15
3.478	Government National Mortgage Association, Series 2017 26, Class IQ, 5,000 %, fällig am 20.02.2040	581	0,05	5.109	Government National Mortgage Association, Series 2021 7, Class TI, 2,500 %, fällig am 16.01.2051	874	0,08
6.860	Government National Mortgage Association, Series 2017 8, Class IO, 0,447 %, fällig am 16.08.2058 *	158	0,01	579	Government National Mortgage Association, Series 2021 8, Class AQ, 5,000 %, fällig am 20.01.2051	576	0,05
461	Government National Mortgage Association, Series 2017 H22, Class JF, 6,199 %, fällig am 20.10.2067 *	458	0,04	3.600	Government National Mortgage Association, Series 2021 9, Class MI, 2,500 %, fällig am 20.01.2051	485	0,04
1.667	Government National Mortgage Association, Series 2018 125, Class HS, 0,816 %, fällig am 20.09.2048 *	156	0,01	5.400	Government National Mortgage Association, Series 2022 102, Class CB, 2,250 %, fällig am 16.06.2064 *	3.075	0,27
2.598	Government National Mortgage Association, Series 2018 134, Class SM, 0,766 %, fällig am 20.10.2048 *	245	0,02	1.100	Government National Mortgage Association, Series 2022 139, Class AL, 4,000 %, fällig am 20.07.2051	982	0,09
749	Government National Mortgage Association, Series 2018 168, Class PA, 4,000 %, fällig am 20.08.2048	699	0,06	9.200	Government National Mortgage Association, Series 2022 147, Class B, 2,200 %, fällig am 16.10.2063	6.363	0,55
621	Government National Mortgage Association, Series 2018 37, Class QA, 2,750 %, fällig am 20.03.2048	535	0,05	9.385	Government National Mortgage Association, Series 2022 158, Class AL, 2,100 %, fällig am 16.08.2064	6.772	0,59
506	Government National Mortgage Association, Series 2018 H09, Class FE, 5,495 %, fällig am 20.06.2068 *	500	0,04	4.326	Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig am 16.02.2061 *	212	0,02
2.471	Government National Mortgage Association, Series 2018 H13, Class DF, 5,598 %, fällig am 20.07.2068 *	2.446	0,21	9.238	Government National Mortgage Association, Series 2022 5, Class LI, 3,500 %, fällig am 20.01.2052	1.624	0,14
500	Government National Mortgage Association, Series 2019 128, Class AL, 2,500 %, fällig am 20.10.2049	341	0,03	1.466	Government National Mortgage Association, Series 2022 50, Class NI, 3,000 %, fällig am 20.09.2048	227	0,02
534	Government National Mortgage Association, Series 2019 18, Class TP, 3,500 %, fällig am 20.02.2049	484	0,04	3.221	Government National Mortgage Association, Series 2022 54, Class Z, 2,000 %, fällig am 16.10.2063 *	1.537	0,13
11.651	Government National Mortgage Association, Series 2019 85, Class LS, 0,000 %, fällig am 20.07.2049 *	264	0,02	38.689	Government National Mortgage Association, Series 2022 55, Class IO, 0,566 %, fällig am 16.01.2063 *	1.718	0,15
139	Government National Mortgage Association, Series 2019 H01, Class FT, 5,863 %, fällig am 20.10.2068 *	138	0,01	1.900	Government National Mortgage Association, Series 2022 63, Class LM, 3,500 %, fällig am 20.10.2050	1.576	0,14
269	Government National Mortgage Association, Series 2019 H08, Class FE, 6,113 %, fällig am 20.01.2069 *	263	0,02	1.300	Government National Mortgage Association, Series 2022 86, Class C, 2,250 %, fällig am 16.10.2063 *	621	0,05
302	Government National Mortgage Association, Series 2019 H10, Class FB, 6,063 %, fällig am 20.06.2069 *	296	0,03	16.406	Government National Mortgage Association, Series 2023 179, Class IO, 0,611 %, fällig am 16.09.2063 *	673	0,06
5.060	Government National Mortgage Association, Series 2020 116, Class GI, 2,500 %, fällig am 20.08.2050	678	0,06	6.353	Government National Mortgage Association, Series 2023 8, Class AZ, 3,750 %, fällig am 16.01.2065	4.562	0,40
1.748	Government National Mortgage Association, Series 2020 122, Class IM, 2,500 %, fällig am 20.08.2050	235	0,02	6.599	Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class AH, 2,000 %, fällig am 16.06.2064	5.079	0,44
3.585	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class EI, 2,500 %, fällig am 20.08.2050	480	0,04				
450	Government National Mortgage Association, Series 2020 129, Class IE, 2,500 %, fällig am 20.09.2050	61	0,01				
155	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig am 20.10.2050	21	–				
5.264	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class QL, 2,500 %, fällig am 20.10.2050	917	0,08				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,52 % (28. Februar 2023: 0,10 %)		
5.999	Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class IA, 0,611 %, fällig am 16.06.2064 *	0,03	17.502	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,52
3.329	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class A, 144A, 7,165 %, fällig am 15.09.2031 *	0,21	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 17.502 \$)		
3.454	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class B, 144A, 8,365 %, fällig am 15.09.2031 *	0,10	17.502	1,52	
227	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Series 2014 GC20, Class A5, 3,998 %, fällig am 10.04.2047	0,02	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.273.391 \$)		
2.120	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8, Series 2017 GS8, Class A4, 3,469 %, fällig am 10.11.2050	0,17	1.178.166	102,47	
1.096	HGI CRE CLO 2021-FL2 Ltd, Series 2021 FL2, Class A, 144A, 6,436 %, fällig am 17.09.2036 *	0,10	Futures – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,03 %)		
1.885	JPMD Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8, Series 2018 C8, Class A4, 4,211 %, fällig am 15.06.2051	0,15	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
1.307	MF1 2021-FL6 Ltd, Series 2021 FL6, Class A, 144A, 6,536 %, fällig am 16.07.2036 *	0,11	313	0,03	
2.423	MF1 2021-FL7 Ltd, Series 2021 FL7, Class A, 144A, 6,514 %, fällig am 16.10.2036 *	0,21	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
980	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig am 25.05.2058 *	0,08	1.178.479	102,50	
1.366	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Series 2021 NQM3, Class A1, 144A, 1,156 %, fällig am 27.11.2056 *	0,10	Hypothekenbesicherte Wertpapiere – -0,55 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
1.480	Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Series 2021 1A, Class A3, 144A, 2,860 %, fällig am 20.06.2051	0,11	(7.700) Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2.500 % ±		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 1.224.272 \$)			1.130.316	98,31	-6.335
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten -6.335 \$)		
USA – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten leerverkauften Wertpapiere (Anschaffungskosten -6.335 \$)		
2.000	PG&E Wildfire Recovery Funding LLC, Series A-4, 5,212 %, fällig am 01.12.2047	0,17	Futures – -0,02 % (28. Februar 2023: 0,06 %)		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.037 \$)			1.973	0,17	-247
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 1,03 % (28. Februar 2023: 2,42 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
USA – 1,03 % (28. Februar 2023: 2,42 %)			-6.582		
5.140	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 14.03.2024	0,45	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
2.690	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 16.04.2024	0,23	1.171.897	101,93	
60	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig am 28.02.2025	-	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
4.320	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig am 30.04.2026	0,35	-22.189	-1,93	
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 12.173 \$)			11.843	1,03	
			Gesamtvermögen		
			1.149.708 \$	100,00	
			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
			144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 37.649.000 USD und machten 3,28 % des Nettovermögens aus.		
			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.		
			± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.		
			ABKÜRZUNGEN:		
			REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit		
			TBA – To be announced.		
			Verteilung des Gesamtvermögens		
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
			82,30		
			Organismen für gemeinsame Anlagen		
			1,24		
			Finanzderivate		
			0,02		
			Sonstige Vermögenswerte		
			16,44		
			Gesamtvermögen		
			100,00		

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2025	Bank of America Merrill Lynch	470	113.135 \$
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	278	30.702
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	131	14.956
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	375	40.090
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	171	20.392
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 353 \$)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -731 \$)			
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -378 \$)			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund^A

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
150 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig am 13.09.2025	150	0,81	50 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig am 06.04.2036	40	0,22
200 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig am 03.06.2031 *	169	0,92	40 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig am 20.03.2060	30	0,17
10 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	13	0,07	10 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig am 15.04.2026	10	0,05
50 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig am 23.07.2048	45	0,24	20 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.04.2029	18	0,10
50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig am 15.03.2051	31	0,17	40 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig am 15.05.2030	34	0,18
30 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig am 15.11.2033	31	0,17	20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig am 15.05.2040	14	0,08
40 Comcast Corp, 4,150 %, fällig am 15.10.2028	39	0,21	20 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig am 15.08.2049	15	0,08
10 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, fällig am 01.04.2030	9	0,05	40 US Bancorp, 1,450 %, fällig am 12.05.2025	38	0,21
60 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig am 15.03.2029	58	0,31	10 US Bancorp, 5,775 %, fällig am 12.06.2029 *	10	0,06
30 Deere & Co, 3,750 %, fällig am 15.04.2050	25	0,13	10 US Bancorp, 5,836 %, fällig am 12.06.2034 *	10	0,06
150 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig am 15.01.2026	155	0,84	10 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig am 10.08.2033	9	0,05
160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	156	0,85	20 Visa Inc, 2,050 %, fällig am 15.04.2030	17	0,09
40 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig am 15.12.2025	40	0,22	30 Visa Inc, 4,300 %, fällig am 14.12.2045	27	0,15
40 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig am 15.06.2045	35	0,19	10 Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, fällig am 15.03.2026	10	0,05
20 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig am 01.12.2029	18	0,10	10 Waste Connections Inc, 5,000 %, fällig am 01.03.2034	10	0,05
10 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig am 01.12.2026	8	0,04	140 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig am 01.02.2050	124	0,67
30 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig am 01.12.2027	29	0,16	20 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, fällig am 01.03.2048	18	0,10
10 Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig am 09.02.2034	19	0,05		4.524	24,59
20 Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig am 15.04.2029	20	0,11			
20 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig am 15.04.2049	20	0,11	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 7.255 \$)		
10 Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, ewig Anleihe *	10	0,05	6.244	33,94	
20 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig am 15.04.2030	19	0,11	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 36,49 % (28. Februar 2023: 27,36 %)		
20 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig am 15.04.2050	19	0,10	Brasilien – 1,47 % (28. Februar 2023: 1,33 %)		
150 EQT Corp, 5,000 %, fällig am 15.01.2029	146	0,80	BRL 579 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, fällig am 01.01.2033	112	0,61
10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig am 15.06.2035	10	0,05	200 Internationale Staatsanleihe Brasilien, 5,000 %, fällig am 27.01.2045	159	0,86
10 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	10	0,05		271	1,47
230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	224	1,22	Indonesien – 1,00 % (28. Februar 2023: 2,35 %)		
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig am 13.11.2030	195	1,06	200 Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 4,625 %, fällig am 15.04.2043	184	1,00
20 General Motors Co, 5,950 %, fällig am 01.04.2049	19	0,11	Mexiko – 7,98 % (28. Februar 2023: 7,42 %)		
20 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig am 15.04.2032	18	0,10	MXN 25.890 Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	1.314	7,14
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig am 15.04.2040	31	0,17	200 Internationale Staatsanleihe Mexiko, 4,350 %, fällig am 15.01.2047	154	0,84
10 Honeywell International Inc, 5,000 %, fällig am 01.03.2035	10	0,05		1.468	7,98
20 Humana Inc, 3,700 %, fällig am 23.03.2029	19	0,10	Peru – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,17 %)		
10 Intel Corp, 5,125 %, fällig am 10.02.2030	10	0,06	30 Internationale Staatsanleihe Peru, 6,550 %, fällig am 14.03.2037	32	0,18
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig am 23.01.2049 *	8	0,04	USA – 25,86 % (28. Februar 2023: 15,97 %)		
10 Kenvue Inc, 4,900 %, fällig am 22.03.2033	10	0,05	360 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig am 15.01.2033 β	347	1,89
10 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig am 01.03.2048	9	0,05	10 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 30.04.2027	10	0,05
40 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	40	0,22	130 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 31.03.2028	127	0,69
10 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig am 15.01.2043	10	0,05	250 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 31.03.2030	241	1,31
30 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig am 24.06.2030	25	0,13	120 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig am 31.07.2030	118	0,64
77 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 20.06.2027	77	0,42	110 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.01.2031	108	0,59
40 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig am 04.05.2025	38	0,21	280 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 28.02.2031	280	1,52
110 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig am 28.04.2026 *	106	0,58	10 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	8	0,05
70 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig am 01.04.2031 *	64	0,35	230 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15.08.2041	153	0,83
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig am 15.02.2029	20	0,11	10 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	7	0,04
20 MPLX LP, 5,500 %, fällig am 15.02.2049	19	0,10	70 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig am 15.11.2042	65	0,35
20 NIKE Inc, 3,375 %, fällig am 27.03.2050	15	0,08	20 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.02.2043	18	0,10
40 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig am 15.01.2028	38	0,20	80 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig am 15.05.2043	73	0,40
20 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig am 01.05.2050	19	0,11	60 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2043	62	0,34
10 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig am 01.11.2026	10	0,06	110 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.02.2049	85	0,46
20 ONEOK Inc, 5,650 %, fällig am 01.11.2028	20	0,11	50 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	38	0,21
20 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig am 01.05.2030	17	0,09	50 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.08.2049	33	0,18
10 Philip Morris International Inc, 4,875 %, fällig am 13.02.2029	10	0,05	200 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	105	0,57
20 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig am 01.05.2030	17	0,09	230 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	129	0,70
10 Philip Morris International Inc, 5,250 %, fällig am 13.02.2034	10	0,05	230 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	138	0,75
20 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig am 20.03.2042	17	0,09	710 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	479	2,61
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, fällig am 12.06.2026 *	10	0,05	50 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	31	0,17
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig am 12.06.2029 *	10	0,06	370 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig am 15.11.2051	221	1,20
10 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig am 15.03.2032	10	0,05	62 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.02.2052	41	0,22
40 RTX Corp, 2,250 %, fällig am 01.07.2030	34	0,18	257 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig am 15.05.2052	194	1,05
10 RTX Corp, 6,000 %, fällig am 15.03.2031	10	0,06	50 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	39	0,21
10 RTX Corp, 4,500 %, fällig am 01.06.2042	9	0,05	40 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig am 15.11.2052	37	0,20
10 Solventum Corp, 144A, 5,400 %, fällig am 01.03.2029	10	0,05	178 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.02.2053	156	0,85
20 Solventum Corp, 144A, 5,450 %, fällig am 13.03.2031	20	0,11	490 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	429	2,33
20 Solventum Corp, 144A, 5,900 %, fällig am 30.04.2054	20	0,11	260 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	249	1,35
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	43	0,24	590 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	628	3,41
10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig am 01.02.2031	9	0,05	110 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	108	0,59
10 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig am 15.02.2026	9	0,05		4.757	25,86
10 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig am 15.02.2029	9	0,05	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 7.857 \$)		
10 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig am 15.04.2030	9	0,05	6.712	36,49	
70 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig am 15.02.2031	59	0,32	Schuldscheindarlehen – 4,83 % (28. Februar 2023: 5,39 %)		
10 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig am 15.02.2031	9	0,05	51 1011778 Bc Ulc, 7,583 %, fällig am 21.09.2030 *	51	0,28
10 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig am 15.04.2031	18	0,10	59 Allied Universal Holdco LLC, 9,183 %, fällig am 14.05.2028 *	58	0,32
10 T-Mobile USA Inc, 5,150 %, fällig am 15.04.2034	10	0,05	10 AmWINS Group, Inc., 7,697 %, fällig am 17.02.2028 *	10	0,05
20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig am 01.02.2026	21	0,11	58 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 7,320 %, fällig am 22.06.2028 *	58	0,32
10 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig am 08.06.2027 *	10	0,06	20 Brown Group Holding LLC, 8,183 %, fällig am 07.06.2028 *	19	0,11
			68 Charter Communications Operating LLC, 7,329 %, fällig am 09.12.2030 *	67	0,36

^A In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Schuldscheindarlehen – (Fortsetzung)					
49 Citadel Securities LP, 7,836 %, fällig am 29.07.2030 *	49	0,26			
10 DCert Buyer, Inc., 9,333 %, fällig am 16.10.2026 *	9	0,05			
19 Gainwell Acquisition Corp, 9,448 %, fällig am 01.10.2027 *	19	0,10			
68 Genesee & Wyoming Inc, 7,448 %, fällig am 30.12.2026 *	68	0,37			
65 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,538 %, fällig am 15.11.2027 *	64	0,35			
10 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,948 %, fällig am 16.03.2027 *	10	0,05			
57 Harbor Freight Tools USA Inc, 8,197 %, fällig am 19.10.2027 *	57	0,31			
19 ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,860 %, fällig am 01.07.2028 *	19	0,10			
5 Indigo Merger Sub, Inc., 7,860 %, fällig am 01.07.2028 *	5	0,03			
35 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 8,447 %, fällig am 05.05.2028 *	35	0,19			
35 Nexstar Broadcasting Inc, 7,951 %, fällig am 19.09.2026 *	35	0,19			
20 Quikrete Holdings, Inc., 8,197 %, fällig am 18.03.2029 *	20	0,11			
60 Sotera Health, 8,197 %, fällig am 13.12.2026 *	60	0,33			
29 Station Casinos LLC, 7,683 %, fällig am 08.02.2027 *	29	0,16			
18 UFC Holdings LLC, 8,336 %, fällig am 29.04.2026 *	18	0,10			
68 Verscend Holding Corp., 9,447 %, fällig am 27.08.2025 *	68	0,37			
60 Virgin Media Bristol LLC, 7,932 %, fällig am 04.01.2029 *	59	0,32			
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 892 \$)	887	4,83			
Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,72 % (28. Februar 2023: 7,28 %)					
133 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	133	0,72			
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 133 \$)	133	0,72			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 20.190 \$)					
	17.621	95,79			
Kontrakte					
(in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert			
Gekaufte Optionen – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,11 %)					
– CME 3 Month SOFR Futures April 2024 Put 94.75, fällig am 12.04.2024 – Morgan Stanley	1	0,01			
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Put 96.00, fällig am 13.12.2024 – Morgan Stanley	18	0,10			
– U.S. 5 Year April 2024 Call 107.25, fällig am 22.03.2024 – Morgan Stanley	1	–			
– U.S. 5 Year April 2024 Call 107.50, fällig am 22.03.2024 – Morgan Stanley	1	0,01			
– U.S. Bond April 2024 Call 120.00, fällig am 22.03.2024 – Morgan Stanley	2	0,01			
300 USD Call/CAD Put 1.3720, fällig am 22.03.2024 – BNP Paribas	–	–			
340 USD Call/CHF Put 0.8725, fällig am 16.03.2024 – Goldman Sachs	5	0,02			
390 USD Call/EUR Put 1.0808, fällig am 12.03.2024 – BNP Paribas	2	0,01			
326 USD Put/AUD Call 0.6686, fällig am 18.04.2024 – BNP Paribas	1	0,01			
350 USD Put/JPY Call 143.42, fällig am 19.04.2024 – BNP Paribas	1	0,01			
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 30 \$)	32	0,18			
Credit Default Swaps – 0,56 % (28. Februar 2023: 0,31 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	103	0,56			
Index-Swaps – 2,10 % (28. Februar 2023: 4,56 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	387	2,10			
Devisenterminkontrakte – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,06 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	20	0,11			
Futures – 0,40 % (28. Februar 2023: 0,85 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	74	0,40			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
	18.237	99,14			
Kontrakte					
(in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert			
Verkaufte Optionen – -0,10 % (28. Februar 2023: 0,21 %)					
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Call 97.1250, fällig am 13.12.2024 – Morgan Stanley	-2	-0,01			
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2024 Put 95.50, fällig am 13.12.2024 – Morgan Stanley	-10	-0,06			

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten 21 \$)					
Zinsswaps – -0,02 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)					
Devisenterminkontrakte – -0,34 % (28. Februar 2023: 0,31 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)					
Futures – -0,21 % (28. Februar 2023: 0,65 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)					
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
	-123	-0,67			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
	18.114	98,47			
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte					
	282	1,53			
Gesamnettovermögen					
	18.396 \$	100,00			
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A	Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.732.000 USD und machten 9,42 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.				
±	Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.				
β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.				
ABKÜRZUNGEN:					
Ewige Anleihe	– Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.				
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit				
TBA	– To be announced.				
BRL	– Brasilianischer Real				
INR	– Indische Rupie				
MXN	– Mexikanischer Peso				
Verteilung des Gesamtvermögens					
Gesamtvermögens					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
87,63					
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden					
4,68					
Organismen für gemeinsame Anlagen					
0,70					
Finanzderivate					
3,25					
Sonstige Vermögenswerte					
3,74					
Gesamtvermögen					
100,00					

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.HY.CDSI 5 Year, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	485	\$ 30
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	3.543	73
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 57 \$)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)				
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 57 \$)				

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.HY.CDSI 5 Year, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	485	\$ 30
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	3.543	73
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 57 \$)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)				
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 57 \$)				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum Floating BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 10,262 %	2. Jan. 2029	3.440	\$ -4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): - \$)				\$ -
Nicht realisierte Wertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): - \$)				-4
Nettowertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): - \$)				\$ -4

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 1,520 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Feb. 2047	325	\$ 112
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 2,600 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	285	52
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,050 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	1.466	163
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,150 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	15. Mai 2048	151	14
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,530 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	31. Okt. 2030	1.773	41
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,540 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	31. Okt. 2030	214	5
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 842 \$)				\$ 387
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2 \$)				-
Nettowertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 840 \$)				\$ 387

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
19. Apr. 2024	BNP Paribas	Kauf USD 407	Verkauf EUR 371	\$ 5
19. Apr. 2024	BNP Paribas	Kauf NOK 1.919	Verkauf EUR 169	-3
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 67	Verkauf CAD 90	1
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 148	Verkauf CHF 130	-
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 87	Verkauf EUR 80	-
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 28	Verkauf IDR 439.678	-
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 81	Verkauf MXN 1.400	-
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf CHF 80	Verkauf USD 91	-
19. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf EUR 4	Verkauf USD 4	-
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf USD 439	Verkauf CNH 3.125	4
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf USD 182	Verkauf MXN 3.140	-
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf IDR 439.327	Verkauf USD 29	-1
19. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf MXN 1.778	Verkauf USD 103	-
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 349	Verkauf GBP 274	4
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 204	Verkauf JPY 29.420	6
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf JPY 37.712	Verkauf USD 253	-
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf CAD 544	Verkauf USD 406	-5
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf JPY 119.578	Verkauf USD 838	-34
19. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf AUD 971	Verkauf USD 652	-19
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 11 \$)				\$ 20
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -58 \$)				-62
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -47 \$)				\$ -42

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Morgan Stanley	-40	\$ -9.465
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Morgan Stanley	24	5730
3 Month SOFR Index Dezember 2025	Morgan Stanley	27	6499
3 Month SOFR Index März 2024	Morgan Stanley	-9	-2.130
3 Month SOFR Index März 2025	Morgan Stanley	2	479
Australian Dollar Currency März 2024	Morgan Stanley	3	195
Euro-Bund März 2024	Morgan Stanley	-3	-430
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Morgan Stanley	-1	-144
Euro-OAT März 2024	Morgan Stanley	2	276
Long Gilt Juni 2024	Morgan Stanley	2	248
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	25	2.761
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Morgan Stanley	-7	-799
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	-24	-4.914
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	69	7.377
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	-11	-1.312
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Morgan Stanley	4	511
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 156 \$)			\$ 74
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -120 \$)			-39
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 36 \$)			\$ 35

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettinventarwert																																																																																																																		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 13,30 % (28. Februar 2023: 14,55 %)																																																																																																																							
Deutschland – 2,94 % (28. Februar 2023: 5,33 %)																																																																																																																							
4.250	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 5,125 %, fällig am 29.09.2025	4,266	2,94																																																																																																																				
Supranational – 10,36 % (28. Februar 2023: 9,22 %)																																																																																																																							
7.300	International Bank for Reconstruction & Development, 2,500 %, fällig am 25.11.2024	7,155	4,93																																																																																																																				
ZAR	49.800 Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, 6,500 %, fällig am 21.01.2027	2,465	1,70																																																																																																																				
MXN	51.300 Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, 7,250 %, fällig am 21.01.2027	2,846	1,96																																																																																																																				
BRL	12.600 International Bank for Reconstruction & Development, 9,500 %, fällig am 09.02.2029	2,558	1,77																																																																																																																				
		15,024	10,36																																																																																																																				
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 18.977 \$)			13,30																																																																																																																				
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 85,07 % (28. Februar 2023: 84,35 %)																																																																																																																							
Australien – 4,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)																																																																																																																							
AUD	8.950 Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig am 21.04.2024	5,806	4,00																																																																																																																				
Brasilien – 5,31 % (28. Februar 2023: 4,34 %)																																																																																																																							
BRL	38.410 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig am 01.01.2025	7,709	5,31																																																																																																																				
Chile – 3,21 % (28. Februar 2023: 0,87 %)																																																																																																																							
	4.813 Chile, internationale Staatsanleihe, 4,950 %, fällig am 05.01.2036	4,653	3,21																																																																																																																				
Kolumbien – 4,45 % (28. Februar 2023: 4,89 %)																																																																																																																							
COP	28.320.000 Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig am 28.05.2042	6,454	4,45																																																																																																																				
Deutschland – 4,06 % (28. Februar 2023: 5,44 %)																																																																																																																							
EUR	5.480 Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig am 17.04.2024	5,896	4,06																																																																																																																				
Mexiko – 9,02 % (28. Februar 2023: 13,18 %)																																																																																																																							
MXN	106.000 Mexikanische Bonos, Serie MS, 8,000 %, fällig am 24.05.2035	5,693	3,92																																																																																																																				
MXN	60.000 Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	3,044	2,10																																																																																																																				
MXN	42.000 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	2,160	1,49																																																																																																																				
MXN	43.000 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053	2,184	1,51																																																																																																																				
		13,081	9,02																																																																																																																				
Neuseeland – 1,37 % (28. Februar 2023: 1,27 %)																																																																																																																							
NZD	2.370 Staatsanleihe Neuseeland, Series 0534, 4,250 %, fällig am 15.05.2034	1,386	0,95																																																																																																																				
NZD	1.480 Neuseeländische Staatsanleihe, Serie 0551, 2,750 %, fällig am 15.05.2051	608	0,42																																																																																																																				
		1,994	1,37																																																																																																																				
Norwegen – 3,90 % (28. Februar 2023: 3,78 %)																																																																																																																							
NOK	60.200 Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig am 14.03.2024	5,664	3,90																																																																																																																				
Südafrika – 3,27 % (28. Februar 2023: 4,06 %)																																																																																																																							
ZAR	56.100 Staatsanleihe Republik Südafrika, Series R214, 6,500 %, fällig am 28.02.2041	1,739	1,20																																																																																																																				
ZAR	79.600 Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig am 28.02.2048	2,999	2,07																																																																																																																				
		4,738	3,27																																																																																																																				
Vereinigtes Königreich – 6,64 % (28. Februar 2023: 4,35 %)																																																																																																																							
GBP	15.570 Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig am 31.07.2051	9,634	6,64																																																																																																																				
USA – 39,84 % (28. Februar 2023: 29,58 %)																																																																																																																							
	8.750 United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,501 %, fällig am 31.10.2025 *	8,749	6,03																																																																																																																				
	31.400 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	29,625	20,42																																																																																																																				
<table border="1"> <thead> <tr> <th>Nennwert (in Tsd.)</th> <th>Wert (in Tsd.) USD</th> <th>% vom Nettinventarwert</th> <th>Nennwert (in Tsd.)</th> <th>Wert (in Tsd.) USD</th> <th>% vom Nettinventarwert</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>5.580</td> <td>United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.02.2052</td> <td>3,652</td> <td>2,52</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>11.640</td> <td>United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.08.2052</td> <td>9,001</td> <td>6,20</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>7.070</td> <td>United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 15.08.2053</td> <td>6,771</td> <td>4,67</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>57,798</td> <td>39,84</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6">Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 129.624 \$)</td> </tr> <tr> <td colspan="6">Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,79 % (28. Februar 2023: 2,53 %)</td> </tr> <tr> <td>2.596</td> <td>Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)</td> <td>2,596</td> <td>1,79</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="3">Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.596 \$)</td> <td>1,79</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6">Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 151.197 \$)</td> </tr> <tr> <td colspan="6">Devisenterminkontrakte – 0,59 % (28. Februar 2023: 1,94 %)</td> </tr> <tr> <td></td> <td>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</td> <td>855</td> <td>0,59</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="3">Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</td> <td>100,75</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6">Devisenterminkontrakte – -1,62 % (28. Februar 2023: 2,45 %)</td> </tr> <tr> <td></td> <td>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</td> <td>-2,346</td> <td>-1,62</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="3">Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</td> <td>-1,62</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="3">Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</td> <td>99,13</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="4">Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte</td> <td>1263</td> <td>0,87</td> </tr> <tr> <td colspan="4">Gesamtneutvermögen</td> <td>145,085 \$</td> <td>100,00</td> </tr> </tbody> </table>						Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettinventarwert	5.580	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.02.2052	3,652	2,52			11.640	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.08.2052	9,001	6,20			7.070	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 15.08.2053	6,771	4,67					57,798	39,84			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 129.624 \$)						Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,79 % (28. Februar 2023: 2,53 %)						2.596	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2,596	1,79			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.596 \$)			1,79			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 151.197 \$)						Devisenterminkontrakte – 0,59 % (28. Februar 2023: 1,94 %)							Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	855	0,59			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			100,75			Devisenterminkontrakte – -1,62 % (28. Februar 2023: 2,45 %)							Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2,346	-1,62			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			-1,62			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			99,13			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte				1263	0,87	Gesamtneutvermögen				145,085 \$	100,00
Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettinventarwert																																																																																																																		
5.580	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.02.2052	3,652	2,52																																																																																																																				
11.640	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig am 15.08.2052	9,001	6,20																																																																																																																				
7.070	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 15.08.2053	6,771	4,67																																																																																																																				
		57,798	39,84																																																																																																																				
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 129.624 \$)																																																																																																																							
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,79 % (28. Februar 2023: 2,53 %)																																																																																																																							
2.596	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2,596	1,79																																																																																																																				
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.596 \$)			1,79																																																																																																																				
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 151.197 \$)																																																																																																																							
Devisenterminkontrakte – 0,59 % (28. Februar 2023: 1,94 %)																																																																																																																							
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	855	0,59																																																																																																																				
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			100,75																																																																																																																				
Devisenterminkontrakte – -1,62 % (28. Februar 2023: 2,45 %)																																																																																																																							
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2,346	-1,62																																																																																																																				
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			-1,62																																																																																																																				
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			99,13																																																																																																																				
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte				1263	0,87																																																																																																																		
Gesamtneutvermögen				145,085 \$	100,00																																																																																																																		
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.																																																																																																																							
144A	Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.664.000 USD und machten 3,90 % des Nettovermögens aus.																																																																																																																						
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.																																																																																																																						

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
COP	– Kolumbianischer Peso
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
MXN	– Mexikanischer Peso
NOK	– Norwegische Krone
NZD	– Neuseeland-Dollar
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,25
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,75
Finanzderivate	0,58
Sonstige Vermögenswerte	1,42
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
6. März 2024	Barclays	Kauf AUD	Verkauf USD	\$ -21
6. März 2024	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf AUD	-13
6. März 2024	JP Morgan	Kauf AUD	Verkauf USD	-123
6. März 2024	Morgan Stanley	Kauf USD	Verkauf AUD	12
6. März 2024	Morgan Stanley	Kauf AUD	Verkauf USD	-95
8. März 2024	Citi	Kauf USD	Verkauf GBP	-35
8. März 2024	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf GBP	4
8. März 2024	Morgan Stanley	Kauf GBP	Verkauf USD	-1
11. März 2024	Barclays	Kauf INR	Verkauf USD	26
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf AUD	1
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf AUD	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf AUD	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf AUD	3

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 69	Verkauf AUD 133	\$ –
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 103	Verkauf CAD 175	1
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf CAD –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1	Verkauf CAD 2	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 444	Verkauf CAD 643	4
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 584	Verkauf CAD 789	2
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 424	Verkauf CNY 3.813	4
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 2.416	Verkauf CNY 17.200	13
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf CNY –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR –	Verkauf CNY –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1.834	Verkauf CNY 14.058	20
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 78	Verkauf DKK 542	-1
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 59	Verkauf DKK 432	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1	Verkauf DKK 13	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 13	Verkauf DKK 119	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf DKK –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf ILS 5	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf NZD –	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf PLN 8	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK 6	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 1.656	Verkauf EUR 1.935	-3
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf NZD –	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf NOK –	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf DKK 2	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf DKK 7	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf JPY 4.451	Verkauf EUR 30	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 3	Verkauf EUR 4	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK 5	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf MXN 53	Verkauf EUR 1	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 131	Verkauf EUR 122	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD 1	Verkauf EUR 1	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf MXN 22	Verkauf EUR 1	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD 12	Verkauf EUR 8	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf JPY 5.257	Verkauf EUR 32	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD 11	Verkauf EUR 8	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNY 307	Verkauf EUR 39	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNY –	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf PLN 3	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD –	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD –	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 9.426	Verkauf EUR 8.763	-49
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf NOK 9	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD –	Verkauf EUR –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1.216	Verkauf GBP 1.041	1
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf JPY 1.012	Verkauf GBP 4	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 1.608	Verkauf GBP 1.279	-6
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 28	Verkauf GBP 21	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf PLN 1	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf NOK 3	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf NOK –	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf JPY 3.489	Verkauf GBP 20	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf MXN 10	Verkauf GBP 1	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD 1	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD –	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf ILS 2	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNY –	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD 3	Verkauf GBP 2	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD 6	Verkauf GBP 3	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD –	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf DKK 3	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf MXN 26	Verkauf GBP 1	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNY 142	Verkauf GBP 15	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 13	Verkauf GBP 11	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD –	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK –	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK 3	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf PLN 3	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf DKK –	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf NZD –	Verkauf GBP –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf NZD –	Verkauf GBP –	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	ILS	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	16	Verkauf	ILS	76
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	95	Verkauf	ILS	345
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	72	Verkauf	ILS	282
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	ILS	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	3.665	Verkauf	JPY	539.890
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.773	Verkauf	JPY	439.618
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	10	Verkauf	JPY	1.704
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	643	Verkauf	JPY	119.158
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	1	Verkauf	JPY	248
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	248	Verkauf	MXN	4.248
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	9	Verkauf	MXN	185
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	43	Verkauf	MXN	938
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	MXN	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	179	Verkauf	MXN	3.286
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	39	Verkauf	NOK	454
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	52	Verkauf	NOK	555
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	NOK	121
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	12	Verkauf	NZD	24
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	NZD	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NZD	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	69	Verkauf	NZD	113
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	53	Verkauf	NZD	92
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	27	Verkauf	PLN	137
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	3	Verkauf	PLN	11
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	114	Verkauf	PLN	496
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	153	Verkauf	PLN	621
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	PLN	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	59	Verkauf	SEK	619
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	11	Verkauf	SEK	137
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SEK	2
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	45	Verkauf	SEK	503
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	117	Verkauf	SGD	158
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	89	Verkauf	SGD	129
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SGD	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SGD	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	21	Verkauf	SGD	36
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	10.357	Verkauf	USD	11.143
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	40	Verkauf	USD	44
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	13	Verkauf	USD	14
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.397	Verkauf	USD	3.014
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	EUR	4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	85	Verkauf	EUR	79
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	24	Verkauf	GBP	19
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	64	Verkauf	GBP	53
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	90	Verkauf	USD	113
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	4	Verkauf	USD	4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	268	Verkauf	USD	175
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	8.130	Verkauf	USD	10.226
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.881	Verkauf	USD	2.024
15. März 2024	JP Morgan	Kauf	USD	6.315	Verkauf	JPY	900.000
15. März 2024	JP Morgan	Kauf	JPY	4.066.000	Verkauf	USD	28.536
15. März 2024	Morgan Stanley	Kauf	JPY	26.000	Verkauf	USD	175
19. März 2024	Citi	Kauf	USD	257	Verkauf	NOK	2.700
19. März 2024	JP Morgan	Kauf	NOK	31.000	Verkauf	USD	2.965
19. März 2024	Morgan Stanley	Kauf	USD	603	Verkauf	NOK	6.300
19. März 2024	Morgan Stanley	Kauf	NOK	31.000	Verkauf	USD	3.016
11. Apr. 2024	HSBC	Kauf	NOK	7.700	Verkauf	USD	749
11. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	USD	726	Verkauf	NOK	7.700
12. Apr. 2024	Barclays	Kauf	USD	2.083	Verkauf	NZD	3.410
12. Apr. 2024	Barclays	Kauf	NZD	770	Verkauf	USD	480
16. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD	5.822	Verkauf	MYR	27.800
16. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	MYR	27.800	Verkauf	USD	6.015
19. Apr. 2024	HSBC	Kauf	USD	6.380	Verkauf	BRL	31.260
25. Apr. 2024	Citi	Kauf	CAD	850	Verkauf	USD	630
26. Apr. 2024	Citi	Kauf	KRW	11.400.000	Verkauf	USD	8.606
29. Apr. 2024	Citi	Kauf	USD	7.060	Verkauf	MXN	123.100
29. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	MXN	4.700	Verkauf	USD	272
30. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	USD	1.214	Verkauf	COP	4.880.000

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)	
2. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf	HUF	1.160.000	Verkauf	USD	3.250	\$	-72
7. Mai 2024	JP Morgan	Kauf	EUR	14.130	Verkauf	USD	15.361		-45
7. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf	EUR	1.260	Verkauf	USD	1.364		2
15. Mai 2024	HSBC	Kauf	USD	7.142	Verkauf	ZAR	136.700		62
28. Mai 2024	JP Morgan	Kauf	CNH	19.270	Verkauf	USD	2.692		-2
6. Juni 2024	JP Morgan	Kauf	AUD	11.420	Verkauf	USD	7.434		12
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 3.132 \$)								\$	855
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.966 \$)									-2.346
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -834 \$)								\$	-1.491

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 23,66 % (28. Februar 2023: 21,89 %)					
1.304 Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, fällig am 10.01.2052	1.266	0,86	36.650 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig am 15.08.2032	32.727	22,37
2.366 Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, fällig am 12.01.2052	2.298	1,57		55.830	38,17
2.477 Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	2.457	1,68	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 93.044 \$)		
891 Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, fällig am 08.01.2052	865	0,59		92.559	63,28
2.743 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig am 09.01.2052	2.598	1,78	Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,53 % (28. Februar 2023: 5,67 %)		
1.956 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, fällig am 10.01.2052	1.853	1,27	8.090 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	8.090	5,53
1.195 Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, fällig am 11.01.2052	1.160	0,79	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 8.090 \$)		
3.645 Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	3.615	2,47		8.090	5,53
1.454 Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, fällig am 20.02.2053	1.446	0,99	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 147.576 \$)		
2.587 Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	2.572	1,76		146.547	100,19
4.628 Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig am 20.05.2053	4.602	3,15	Devisenterminkontrakte – 2,08 % (28. Februar 2023: 2,41 %)		
1.627 Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, fällig am 20.06.2053	1.590	1,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	3.036	2,08
2.226 Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, fällig am 20.06.2053	2.213	1,51	Futures – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,41 %)		
1.716 Ginnie Mae II Pool 'MA9106', 5,500 %, fällig am 20.08.2053	1.705	1,16	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	256	0,17
4.398 Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, fällig am 20.09.2053	4.372	2,99	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
				149.839	102,44
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 35.020 \$)					
	34.612	23,66	Devisenterminkontrakte – -2,69 % (28. Februar 2023: 4,38 %)		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 7,72 % (28. Februar 2023: 7,26 %)					
Australien – 2,21 % (28. Februar 2023: 4,87 %)					
3.220 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 6,094 %, fällig am 14.03.2025 *	3.235	2,21	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				-3.927	-2,69
Mexiko – 1,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
2.320 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig am 28.01.2060	1.480	1,01	Futures – -0,03 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				-51	-0,03
USA – 4,50 % (28. Februar 2023: 2,39 %)					
2.880 General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig am 06.04.2026	2.882	1,97	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
1.015 Jabil Inc, 3,000 %, fällig am 15.01.2031	868	0,60		-3.978	-2,72
2.850 Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig am 18.05.2026	2.821	1,93	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
				145.861	99,72
	6.571	4,50	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
				408	0,28
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 11.422 \$)					
	11.286	7,72	Gesamtvermögen		
				146.269 \$	100,00
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 63,28 % (28. Februar 2023: 65,08 %)					
Brasilien – 3,61 % (28. Februar 2023: 7,30 %)					
BRL 27.300 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig am 01.01.2033	5.284	3,61	– Beträge, die mit „-“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
Kolumbien – 6,98 % (28. Februar 2023: 5,75 %)					
COP 16.800.000 Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig am 28.05.2042	3.829	2,62	144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.235.000 USD und machten 2,21 % des Nettovermögens aus.		
COP 35.300.000 Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050	6.388	4,36	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.		
	10.217	6,98			
Mexiko – 6,01 % (28. Februar 2023: 5,75 %)					
MXN 48.900 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	2.514	1,72	ABKÜRZUNGEN:		
MXN 123.500 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053	6.273	4,29	– Brasilianischer Real		
	8.787	6,01	– Kolumbianischer Peso		
Neuseeland – 2,59 % (28. Februar 2023: 2,68 %)					
NZD 9.210 Neuseeländische Staatsanleihe, Serie 0551, 2,750 %, fällig am 15.05.2051	3.784	2,59	– Britisches Pfund Sterling		
			– Mexikanischer Peso		
Südafrika – 3,55 % (28. Februar 2023: 2,91 %)					
ZAR 137.800 Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig am 28.02.2048	5.192	3,55	– Neuseeland-Dollar		
			– Südafrikanischer Rand		
Vereinigtes Königreich – 2,37 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
GBP 5.600 Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig am 31.07.2051	3.465	2,37			
USA – 38,17 % (28. Februar 2023: 32,72 %)					
23.090 United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig am 30.04.2025 *	23.103	15,80			

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
6. März 2024	Barclays	Kauf AUD	Verkauf USD	9.839 \$ -276
6. März 2024	Citi	Kauf USD	Verkauf AUD	3.150 62
6. März 2024	Citi	Kauf AUD	Verkauf USD	3.342 -98
6. März 2024	HSBC	Kauf USD	Verkauf AUD	1.220 9
6. März 2024	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf AUD	42.280 -48
6. März 2024	JP Morgan	Kauf AUD	Verkauf USD	15.334 -323
6. März 2024	Morgan Stanley	Kauf USD	Verkauf AUD	2.470 24
6. März 2024	Morgan Stanley	Kauf AUD	Verkauf USD	4.178 -62
8. März 2024	HSBC	Kauf USD	Verkauf GBP	440 2
8. März 2024	HSBC	Kauf GBP	Verkauf USD	812 -4
8. März 2024	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf GBP	3.860 4
8. März 2024	Morgan Stanley	Kauf GBP	Verkauf USD	700 -5
8. März 2024	Morgan Stanley	Kauf GBP	Verkauf USD	819 2
11. März 2024	Barclays	Kauf USD	Verkauf INR	170.000 -7
11. März 2024	Barclays	Kauf INR	Verkauf USD	8.197 -
11. März 2024	Barclays	Kauf INR	Verkauf USD	1.201 4
12. März 2024	Barclays	Kauf USD	Verkauf CHF	430 2

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
12. März 2024	Barclays	Kauf CHF 9.870	Verkauf USD 11.607	\$ -431
12. März 2024	Citi	Kauf CHF 4.330	Verkauf USD 5.007	-104
12. März 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 48.898	Verkauf CHF 42.360	934
12. März 2024	Goldman Sachs	Kauf CHF 13.640	Verkauf USD 15.671	-227
12. März 2024	HSBC	Kauf CHF 380	Verkauf USD 432	-2
12. März 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 5.966	Verkauf CHF 5.100	192
13. März 2024	Citi	Kauf USD 2.026	Verkauf KRW 2.700.000	-
13. März 2024	Citi	Kauf KRW 10.680.000	Verkauf USD 8.168	-150
13. März 2024	Citi	Kauf KRW 1.700.000	Verkauf USD 1.276	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 21	Verkauf EUR 19	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 4.523	Verkauf EUR 4.166	16
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD -	Verkauf GBP -	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 7.139	Verkauf USD 7.681	40
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 11.735	Verkauf USD 14.761	54
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 30	Verkauf USD 38	-
15. März 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 5.855	Verkauf JPY 830.000	305
15. März 2024	JP Morgan	Kauf USD 9.699	Verkauf JPY 1.378.000	485
15. März 2024	JP Morgan	Kauf JPY 2.208.000	Verkauf USD 15.496	-733
15. März 2024	Morgan Stanley	Kauf JPY 1.070.000	Verkauf USD 7.346	-192
19. März 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 5.786	Verkauf NOK 61.220	19
19. März 2024	Goldman Sachs	Kauf NOK 60.700	Verkauf USD 5.924	-206
19. März 2024	JP Morgan	Kauf NOK 62.400	Verkauf USD 5.967	-89
19. März 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 6.559	Verkauf NOK 68.800	78
19. März 2024	Morgan Stanley	Kauf NOK 43.500	Verkauf USD 4.168	-71
19. März 2024	UBS	Kauf USD 266	Verkauf NOK 2.800	2
22. März 2024	Barclays	Kauf USD 9.550	Verkauf SEK 98.000	87
22. März 2024	Goldman Sachs	Kauf SEK 76.800	Verkauf USD 7.354	61
22. März 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 1.308	Verkauf SEK 13.600	-5
22. März 2024	Morgan Stanley	Kauf SEK 13.500	Verkauf USD 1.321	-17
22. März 2024	UBS	Kauf SEK 21.300	Verkauf USD 2.038	19
12. Apr. 2024	Barclays	Kauf USD 26.321	Verkauf NZD 42.400	505
12. Apr. 2024	Citi	Kauf USD 3.293	Verkauf NZD 5.350	36
12. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf USD 167	Verkauf NZD 270	2
12. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf NZD 5.350	Verkauf USD 3.313	-56
12. Apr. 2024	Standard Chartered Bank	Kauf NZD 480	Verkauf USD 292	-
12. Apr. 2024	UBS	Kauf NZD 550	Verkauf USD 339	-4
18. Apr. 2024	Barclays	Kauf NOK 2.400	Verkauf USD 229	-2
18. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf NOK 148.900	Verkauf USD 14.538	-501
18. Apr. 2024	UBS	Kauf USD 7.319	Verkauf NOK 78.200	-52
19. Apr. 2024	HSBC	Kauf USD 221	Verkauf BRL 1.100	1
19. Apr. 2024	HSBC	Kauf BRL 5.980	Verkauf USD 1.221	-24
2. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 2.793	Verkauf HUF 1.020.000	-1
2. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf HUF 1.020.000	Verkauf USD 2.858	-63
7. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf EUR 5.450	Verkauf USD 5.939	-31
13. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf HUF 60.000	Verkauf USD 166	-2
13. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 2.436	Verkauf HUF 890.000	-2
13. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf HUF 3.460.000	Verkauf USD 9.531	-56
15. Mai 2024	HSBC	Kauf USD 5.392	Verkauf ZAR 103.200	47
15. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf ZAR 3.000	Verkauf USD 154	1
17. Mai 2024	HSBC	Kauf USD 2.660	Verkauf CLP 2.640.000	-66
17. Mai 2024	HSBC	Kauf CLP 7.040.000	Verkauf USD 7.284	-17
6. Juni 2024	JP Morgan	Kauf AUD 41.570	Verkauf USD 27.059	43
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 13.024 \$)				\$ 3.036
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -23.627 \$)				-3.927
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -10.603 \$)				\$ -891

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-OAT März 2024	Morgan Stanley	-135	\$ -18.631
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2024	Morgan Stanley	-32	-31.219
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.190 \$)			\$ 256
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): - \$)			-51
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.190 \$)			\$ 205

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Vorzugsaktien – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
USA – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
2 BrightSpring Health Services Inc	76	0,25
Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 100 \$)	76	0,25
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 29.865 \$)	30.535	97,98
Devisenterminkontrakte – 0,12 % (28. Februar 2023: 0,10 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	38	0,12
Futures – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,01 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	30.574	98,10
Devisenterminkontrakte – –0,23 % (28. Februar 2023: 1,94 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-71	-0,23
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-71	-0,23
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	30.503	97,87
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	661	2,13
Gesamtnettvermögen	31.164 \$	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 20.655.000 USD und machten 66,29 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.

ABKÜRZUNGEN:

EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund Sterling

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,24
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,27
Finanzderivate	0,12
Sonstige Vermögenswerte	3,37
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
8. März 2024	JP Morgan	Kauf GBP 180	Verkauf USD 227	\$ –
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD 1	Verkauf CHF 1	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1	Verkauf CHF 1	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf CHF –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD 2.672	Verkauf EUR 1.838	-18
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 11	Verkauf EUR 13	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD 294	Verkauf GBP 173	-2
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 161	Verkauf GBP 137	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 2	Verkauf SEK 19	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD 3	Verkauf SEK 24	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf SEK –	–
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf CAD 12.203	Verkauf USD 9.028	-35
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 50	Verkauf USD 63	1
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 6.671	Verkauf USD 7.176	37
7. Mai 2024	Barclays	Kauf USD 162	Verkauf EUR 150	–
7. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD 433	Verkauf EUR 400	-1
7. Mai 2024	JP Morgan	Kauf EUR 4.250	Verkauf USD 4.620	-13
7. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 226	Verkauf EUR 210	-2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 10 \$)				\$ 38
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -202 \$)				-71
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -192 \$)				\$ -33

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2024	Citi	26	\$ 2.871
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2 \$)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)			
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2 \$)			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 13,23 % (28. Februar 2023: 13,19 %)			USA – 35,49 % (28. Februar 2023: 28,57 %)		
987 Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig am 01.09.2052	935	0,45	8.110 United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,501 %, fällig am 31.10.2025 *	8.109	3,91
1.501 Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, fällig am 10.01.2052	1.458	0,70	37.750 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	35.616	17,17
3.217 Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, fällig am 12.01.2052	3.124	1,51	12.440 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	12.072	5,82
3.606 Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	3.576	1,73	11.280 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	8.723	4,21
1.461 Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, fällig am 08.01.2052	1.418	0,68	9.480 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	9.079	4,38
1.819 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, fällig am 10.01.2052	1.723	0,83		73.599	35,49
1.792 Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, fällig am 11.01.2052	1.740	0,84			
4.356 Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	4.320	2,08			
8.798 Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000 %, fällig am 20.10.2052	8.611	4,15			
533 Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig am 20.05.2053	530	0,26			
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 27.629 \$)	27.435	13,23	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 179.817 \$)	174.753	84,27
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 0,95 % (28. Februar 2023: 6,05 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,73 % (28. Februar 2023: 1,99 %)		
Mexiko – 0,95 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			3.580 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		
3.110 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig am 28.01.2060	1.984	0,95		3.580	1,73
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.972 \$)	1.984	0,95	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.580 \$)	3.580	1,73
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 84,27 % (28. Februar 2023: 78,56 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 212.998 \$)		
Australien – 4,48 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Devisenterminkontrakte – 0,45 % (28. Februar 2023: 0,71 %)		
AUD 14.310 Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig am 21.04.2024	9.283	4,48	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Brasilien – 3,87 % (28. Februar 2023: 5,44 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
BRL 16.370 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig am 01.01.2027	3.289	1,59	208.694		
BRL 8.110 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig am 01.01.2029	1.606	0,77	Devisenterminkontrakte – -1,85 % (28. Februar 2023: 2,07 %)		
BRL 9.230 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	1.800	0,87	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
BRL 6.860 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig am 01.01.2033	1.329	0,64	-3.847		
	8.024	3,87	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Kolumbien – 6,19 % (28. Februar 2023: 5,87 %)			-3.847		
COP 14.690.000 Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig am 26.03.2031	3.269	1,58	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
COP 36.690.000 Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig am 28.05.2042	8.361	4,03	204.847		
COP 6.640.000 Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050	1.202	0,58	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	12.832	6,19	2.529		
Deutschland – 4,57 % (28. Februar 2023: 5,84 %)			Gesamtnettovermögen		
EUR 8.810 Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig am 17.04.2024	9.478	4,57	207.376 \$		
Mexiko – 10,06 % (28. Februar 2023: 12,40 %)			100,00		
MXN 116.400 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 18.11.2038	6.445	3,11	–		
MXN 114.600 Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	5.815	2,80	–		
MXN 80.200 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	4.124	1,99	–		
MXN 88.100 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053	4.475	2,16	–		
	20.859	10,06	–		
Neuseeland – 0,76 % (28. Februar 2023: 0,82 %)			–		
NZD 3.860 Neuseeländische Staatsanleihe, Serie 0551, 2,750 %, fällig am 15.05.2051	1.586	0,76	–		
Norwegen – 4,40 % (28. Februar 2023: 0,74 %)			–		
NOK 97.000 Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig am 14.03.2024	9.127	4,40	–		
Südafrika – 4,34 % (28. Februar 2023: 3,69 %)			–		
ZAR 108.600 Staatsanleihe Republik Südafrika, Series R214, 6,500 %, fällig am 28.02.2041	3.366	1,62	–		
ZAR 149.500 Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig am 28.02.2048	5.633	2,72	–		
	8.999	4,34	–		
Vereinigtes Königreich – 10,11 % (28. Februar 2023: 0,76 %)			–		
GBP 9.500 Vereinigtes Königreich, Gilt, 3,250 %, fällig am 31.01.2033	11.270	5,43	–		
GBP 15.670 Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig am 31.07.2051	9.696	4,68	–		
	20.966	10,11	–		

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
6. März 2024	Barclays	Kauf AUD	Verkauf USD	\$ -59
6. März 2024	HSBC	Kauf USD	Verkauf AUD	35
6. März 2024	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf AUD	-27
6. März 2024	JP Morgan	Kauf AUD	Verkauf USD	-188
6. März 2024	Morgan Stanley	Kauf USD	Verkauf AUD	64
6. März 2024	Morgan Stanley	Kauf AUD	Verkauf USD	-334
8. März 2024	Citi	Kauf USD	Verkauf GBP	-66
8. März 2024	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf GBP	-18
8. März 2024	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf GBP	4
11. März 2024	Barclays	Kauf INR	Verkauf USD	48
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf AUD	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	AUD	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	266	Verkauf	AUD	248	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	38	Verkauf	CAD	63	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	CAD	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	393	Verkauf	CAD	323	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	153	Verkauf	CNY	1.377	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	CNY	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.628	Verkauf	CNY	7.045	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	52	Verkauf	DKK	222	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	4	Verkauf	DKK	43	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	592	Verkauf	EUR	692	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	6.278	Verkauf	EUR	3.538	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	EUR	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.026	Verkauf	GBP	494	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	GBP	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	ILS	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	63	Verkauf	ILS	141	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	ILS	28	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	JPY	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	233	Verkauf	JPY	43.129	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	2.470	Verkauf	JPY	220.605	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	167	Verkauf	MXN	1.736	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	MXN	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	16	Verkauf	MXN	339	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	35	Verkauf	NOK	227	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	3	Verkauf	NOK	45	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	4	Verkauf	NZD	9	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	10	Verkauf	PLN	49	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	PLN	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	103	Verkauf	PLN	253	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	40	Verkauf	SEK	253	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	4	Verkauf	SEK	49	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	SEK	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	7	Verkauf	SGD	13	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	79	Verkauf	SGD	64	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	9.226	Verkauf	USD	5.599	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	USD	–	
12. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	870	Verkauf	USD	1.094	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	–	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	31	Verkauf	USD	39	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	6	Verkauf	USD	6	
15. März 2024	JP Morgan	Kauf	USD	10.192	Verkauf	JPY	1.448.000	
15. März 2024	JP Morgan	Kauf	JPY	6.411.000	Verkauf	USD	44.994	
19. März 2024	HSBC	Kauf	USD	2.098	Verkauf	NOK	21.900	
19. März 2024	HSBC	Kauf	NOK	33.200	Verkauf	USD	3.218	
19. März 2024	JP Morgan	Kauf	NOK	64.100	Verkauf	USD	6.130	
19. März 2024	Morgan Stanley	Kauf	USD	4.251	Verkauf	NOK	44.400	
19. März 2024	Morgan Stanley	Kauf	NOK	17.900	Verkauf	USD	1.741	
12. Apr. 2024	Barclays	Kauf	USD	1.020	Verkauf	NZD	1.670	
16. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD	6.030	Verkauf	MYR	28.800	
16. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	MYR	28.800	Verkauf	USD	6.232	
18. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf	NOK	68.000	Verkauf	USD	6.639	
26. Apr. 2024	Citi	Kauf	KRW	22.050.000	Verkauf	USD	16.644	
29. Apr. 2024	Citi	Kauf	USD	4.233	Verkauf	MXN	73.800	
30. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	USD	2.685	Verkauf	COP	10.790.000	
2. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf	HUF	2.250.000	Verkauf	USD	6.304	
7. Mai 2024	Goldman Sachs	Kauf	EUR	2.150	Verkauf	USD	2.343	
7. Mai 2024	JP Morgan	Kauf	EUR	10.640	Verkauf	USD	11.567	
7. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.313	Verkauf	EUR	1.210	
15. Mai 2024	HSBC	Kauf	USD	9.132	Verkauf	ZAR	174.800	
6. Juni 2024	JP Morgan	Kauf	AUD	23.670	Verkauf	USD	15.407	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1.448 \$)							\$	942
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -4.239 \$)								-3.847
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.791 \$)							\$	-2.905

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert		
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,40 % (28. Februar 2023: 0,00 %)							
4.380	Bellemeade Re 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M1B, 144A, 9,572 %, fällig am 25.10.2033 *	4.527	0,39	3.420	Minerva Luxembourg SA, 144A, 8,875 %, fällig am 13.09.2033	3.599	0,31
136	Eagle RE 2021-1 Ltd, Series 2021 1, Class M1C, 144A, 8,022 %, fällig am 25.10.2033 *	136	0,01	2.270	Raizen Fuels Finance SA, 144A, 6,450 %, fällig am 05.03.2034	2.284	0,20
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 4.701 \$)		4.663	0,40	1.535	Rumo Luxembourg Sarl, 144A, 4,200 %, fällig am 18.01.2032	1.281	0,11
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 14,72 % (28. Februar 2023: 17,87 %)							
11.135	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 1M2, 144A, 9,086 %, fällig am 25.02.2040 *	11.739	1,02	13.775	XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig am 01.07.2026	12.872	1,12
12.085	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 2M2, 144A, 9,086 %, fällig am 25.02.2040 *	12.737	1,11	Kanada – 4,36 % (28. Februar 2023: 2,19 %)			
4.300	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-RO2, Series 2023 RO2, Class 1B1, 144A, 10,872 %, fällig am 25.01.2043 *	4.729	0,41	3.349	Air Canada 2015-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 3,600 %, fällig am 15.03.2027	3.170	0,28
7.602	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 CO2, Class 2M2C, 9,086 %, fällig am 25.09.2029 *	8.015	0,70	6.676	Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, fällig am 01.04.2029	6.553	0,57
2.124	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 CO6, Class 2M2, 8,236 %, fällig am 25.02.2030 *	2.205	0,19	5.590	Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, fällig am 15.01.2027	4.983	0,43
5.930	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2021 RO2, Class 2B1, 144A, 8,622 %, fällig am 25.11.2041 *	6.111	0,53	9.280	Baytex Energy Corp, 144A, 8,500 %, fällig am 30.04.2030	9.657	0,84
2.343	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA4, Series 2020 HQA4, Class B1, 144A, 10,686 %, fällig am 25.09.2050 *	2.573	0,22	11.190	Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 01.04.2026	10.796	0,94
5.855	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA5, Series 2020 HQA5, Class B1, 144A, 9,322 %, fällig am 25.11.2050 *	6.480	0,56	8.930	Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	8.803	0,76
3.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, Series 2021 HQA2, Class B1, 144A, 8,472 %, fällig am 25.12.2033 *	3.220	0,28	6.600	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2029	6.270	0,54
4.720	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Series 2022 DNA3, Class M1B, 144A, 8,222 %, fällig am 25.04.2042 *	4.892	0,43	Chile – 0,54 % (28. Februar 2023: 0,99 %)			
5.105	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Series 2022 DNA3, Class M2, 144A, 9,672 %, fällig am 25.04.2042 *	5.440	0,47	6.680	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig am 27.04.2026	6.202	0,54
2.780	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Series 2022 DNA4, Class M1B, 144A, 8,672 %, fällig am 25.05.2042 *	2.926	0,25	Kolumbien – 0,63 % (28. Februar 2023: 0,95 %)			
12.635	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Series 2022 DNA4, Class M2, 144A, 10,572 %, fällig am 25.05.2042 *	13.721	1,19	3.100	Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig am 13.01.2033	3.261	0,28
7.420	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Series 2022 DNA5, Class M1B, 144A, 9,822 %, fällig am 25.06.2042 *	8.041	0,70	4.420	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 17.01.2027	4.009	0,35
13.690	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Series 2022 DNA5, Class M2, 144A, 12,072 %, fällig am 25.06.2042 *	15.466	1,34	Tschechische Republik – 0,44 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			
5.005	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Series 2022 DNA6, Class M2, 144A, 11,072 %, fällig am 25.09.2042 *	5.607	0,49	4.850	Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, fällig am 30.04.2029	5.002	0,44
2.600	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA2, Series 2022 HQA2, Class M2, 144A, 11,322 %, fällig am 25.07.2042 *	2.870	0,25	Deutschland – 3,37 % (28. Februar 2023: 0,35 %)			
7.950	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA1, Series 2023 DNA1, Class B1, 144A, 13,472 %, fällig am 25.03.2043 *	9.079	0,79	41.200	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,375 %, fällig am 18.07.2025	38.735	3,37
6.710	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA3, Series 2023 HQA3, Class M2, 144A, 8,672 %, fällig am 25.11.2043 *	7.022	0,61	Irland – 1,08 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			
12.697	Freddie Mac STACR Trust 2018-HQA2, Series 2018 HQA2, Class M2B, 144A, 7,736 %, fällig am 25.10.2048 *	13.146	1,14	3.330	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 6,375 %, fällig am 04.05.2028	3.381	0,29
20.047	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	19.928	1,73	8.900	GGAM Finance Ltd, 144A, 7,750 %, fällig am 15.05.2026	9.050	0,79
3.232	STACR Trust 2018-HRP2, Series 2018 HRP2, Class B1, 144A, 9,636 %, fällig am 25.02.2047 *	3.540	0,31	Israel – 2,93 % (28. Februar 2023: 0,76 %)			
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 168.201 \$)		169.487	14,72	8.385	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig am 30.03.2026	7.884	0,68
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 57,95 % (28. Februar 2023: 58,40 %)							
Argentinien – 0,65 % (28. Februar 2023: 0,00 %)							
2.129	YPF SA, 9,000 %, fällig am 12.02.2026	2.130	0,18	5.940	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig am 30.03.2028	5.334	0,46
5.350	YPF SA, 144A, 9,500 %, fällig am 17.01.2031	5.394	0,47	3.545	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 8,500 %, fällig am 30.09.2033	3.426	0,30
		7.524	0,65	7.700	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, fällig am 30.06.2025	7.555	0,66
Australien – 0,54 % (28. Februar 2023: 0,40 %)							
1.710	Mineral Resources Ltd, 144A, 8,125 %, fällig am 01.05.2027	1.727	0,15	8.040	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 30.06.2027	7.717	0,67
3.860	Mineral Resources Ltd, 144A, 9,250 %, fällig am 01.10.2028	4.053	0,35	1.980	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig am 30.06.2030	1.816	0,16
AUD	730 NBN Co Ltd, 2,200 %, fällig am 16.12.2030	392	0,04	Italien – 0,59 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			
		6.172	0,54	6.850	Telecom Italia SpA.Milano, 144A, 5,303 %, fällig am 30.05.2024	6.831	0,59
Bermuda – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,00 %)							
2.460	RenaissanceRe Holdings Ltd, 5,750 %, fällig am 05.06.2033	2.482	0,22	Jersey – 0,65 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			
Brasilien – 2,97 % (28. Februar 2023: 2,47 %)							
680	Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig am 28.01.2028	651	0,06	7.410	Aston Martin Capital Holdings Ltd, 144A, 10,500 %, fällig am 30.11.2025	7.520	0,65
6.040	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 8,500 %, fällig am 12.01.2031	5.920	0,52	Luxemburg – 0,66 % (28. Februar 2023: 0,79 %)			
5.070	CSN Resources SA, 144A, 8,875 %, fällig am 05.12.2030	5.205	0,45	2.535	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig am 15.08.2029	2.186	0,19
2.488	ERO Copper Corp, 144A, 6,500 %, fällig am 15.02.2030	2.347	0,20	10.770	Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig am 15.02.2028	5.449	0,47
				Mexiko – 0,55 % (28. Februar 2023: 0,24 %)			
				3.770	Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig am 15.11.2029	2.851	0,25
				1.005	Braskem Idesa SAPI, 6,990 %, fällig am 20.02.2032	726	0,06
				3.000	Trust Fibra Uno, 4,869 %, fällig am 15.01.2030	2.732	0,24
				Panama – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,29 %)			
				3.884	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig am 31.05.2030	3.263	0,28
Supranational – 7,02 % (28. Februar 2023: 1,11 %)							
				37.800	International Bank for Reconstruction & Development, 0,500 %, fällig am 28.10.2025	35.231	3,06
				61.000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig am 22.01.2026	3.244	0,28
				17.100	International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig am 22.01.2026	3.242	0,28
				38.700	International Bank for Reconstruction & Development, 4,625 %, fällig am 01.08.2028	39.078	3,40
				Schweiz – 0,30 % (28. Februar 2023: 0,15 %)			
				3.450	UBS Group AG, 144A, 5,699 %, fällig am 08.02.2035 *	3.414	0,30

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Sambia – 1,57 % (28. Februar 2023: 1,50 %)			
Vereinigtes Königreich – 1,08 % (28. Februar 2023: 1,17 %)			(Anschaffungskosten 698.732 \$)			
6.070	Connect Finco SARR / Connect US Finco LLC, 144A, 6,750 %, fällig am 01.10.2026	5,960	3.773	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig am 01.04.2025	0,33	
1.075	Nationwide Building Society, 5,750 %, Ewige Anleihe *	1,262	5.970	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 01.03.2026	0,52	
3.625	NatWest Group Plc, 4,600 %, Ewige Anleihe *	2,730	8.800	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027	0,72	
2.900	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031	2,511	18.120		1,57	
		12.463				
USA – 27,52 % (28. Februar 2023: 42,28 %)			Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 698.732 \$)			
3.665	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig am 15.02.2026	3,684	667.190		57,95	
7.770	Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig am 15.12.2027	7.174	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 23,78 % (28. Februar 2023: 11,58 %)			
6.505	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, fällig am 15.08.2027	6.328	Brasilien – 3,36 % (28. Februar 2023: 3,45 %)			
2.680	AmeriTex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 10,250 %, fällig am 15.10.2028	2.811	BRL	136.410	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig am 01.01.2027	2,38
5.515	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, fällig am 15.08.2026	5.095	BRL	56.890	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig am 01.01.2029	0,98
435	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	316			38.678	3,36
1.890	Ares Capital Corp, 3,250 %, fällig am 15.07.2025	1.816	Kolumbien – 6,00 % (28. Februar 2023: 2,95 %)			
2.530	Ares Capital Corp, 2,875 %, fällig am 15.06.2028	2.217	COP	211.704.000	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig am 26.03.2031	4,09
7.945	Bain Capital Specialty Finance Inc, 2,950 %, fällig am 10.03.2026	7.439	COP	121.618.000	Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050	1,91
9.170	Blackstone Secured Lending Fund, 2,125 %, fällig am 15.02.2027	8.234			69.119	6,00
2.645	Blackstone Secured Lending Fund, 2,850 %, fällig am 30.09.2028	2.304	Mexiko – 5,51 % (28. Februar 2023: 2,93 %)			
1.160	Blue Owl Capital Corp, 4,000 %, fällig am 30.03.2025	1.133	MXN	758.600	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,500 %, fällig am 26.05.2033	3,48
4.330	Blue Owl Capital Corp, 2,625 %, fällig am 15.01.2027	3.927	MXN	460.800	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053	2,03
5.515	Blue Owl Credit Income Corp, 3,125 %, fällig am 23.09.2026	5.024			63.420	5,51
2.550	Blue Owl Credit Income Corp, 7,750 %, fällig am 16.09.2027	2.610	Spanien – 3,04 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			
4.040	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig am 15.12.2025	3.852	EUR	48.420	Spanische Staatsanleihe, 144A, 1,900 %, fällig am 31.10.2052	3,04
10.861	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 3,750 %, fällig am 17.06.2026	9.993	Vereinigtes Königreich – 5,87 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			
2.170	Capital One Financial Corp, 6,312 %, fällig am 08.06.2029 *	2.222	GBP	61.470	United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig am 22.10.2053	5,87
3.015	Capital One Financial Corp, 7,624 %, fällig am 30.10.2031 *	3.301	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 255.971 \$)			
3.723	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig am 15.03.2026	3.689			273.766	23,78
4.900	Civitas Resources Inc, 144A, 8,375 %, fällig am 01.07.2028	5.134	Schuldscheindarlehen – 0,47 % (28. Februar 2023: 0,43 %)			
6.860	Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 01.10.2028	5.672			2.175	0,19
10.105	Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig am 15.03.2026	10.075			3.263	0,28
6.020	DaVita Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 01.06.2030	5.301	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 5.384 \$)			
27.582	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig am 15.08.2026	16.446			5.438	0,47
2.670	Enviri Corp, 144A, 5,750 %, fällig am 31.07.2027	2.497	Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,78 % (28. Februar 2023: 7,05 %)			
5.215	FS KKR Capital Corp, 3,125 %, fällig am 12.10.2028	4.508			20.461	1,78
7.270	Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, fällig am 24.08.2026	6.638	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 20.461 \$)			
6.560	Golub Capital BDC Inc, 2,050 %, fällig am 15.02.2027	5.788	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.153.450 \$)			
13.773	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 15.08.2028	12.220			1.141.005	99,10
5.387	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig am 15.06.2025	5.399	Devisenterminkontrakte – 0,53 % (28. Februar 2023: 0,29 %)			
12.890	KeyBank NA/Cleveland OH, Series BKNT, 5,674 %, fällig am 14.06.2024 *	12.845			6.119	0,53
1.025	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig am 01.02.2030	670	Futures – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			
12.100	Main Street Capital Corp, 3,000 %, fällig am 14.07.2026	11.200			55	–
6.945	MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig am 15.06.2028	6.704	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
9.888	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 20.06.2027	9.898			1.147.179	99,63
8.820	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, fällig am 01.02.2026	8.324	Credit Default Swaps – 0,18 % (28. Februar 2023: -0,07 %)			
18.660	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig am 15.09.2025	18.581			-2.085	-0,18
9.530	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 30.09.2026	9.212	Devisenterminkontrakte – -0,41 % (28. Februar 2023: 1,02 %)			
3.830	Nexstar Media Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.11.2028	3.405			-4.746	-0,41
5.000	NFP Corp, 144A, 7,500 %, fällig am 01.10.2030	5.266	Futures – -0,02 % (28. Februar 2023: 0,31 %)			
3.255	Nordstrom Inc, 2,300 %, fällig am 08.04.2024	3.245			-274	-0,02
7.265	PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 01.10.2029	6.092	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			
1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,400 %, fällig am 15.04.2033	1.685			-7.105	-0,61
3.190	Star Parent Inc, 144A, 9,000 %, fällig am 01.10.2030	3.371	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
5.954	Synchrony Bank, 5,625 %, fällig am 23.08.2027	5.796			1.140.074	99,02
987	Synchrony Financial, 4,250 %, fällig am 15.08.2024	978	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			
7.135	Synchrony Financial, 7,250 %, fällig am 02.02.2033	6.941			11.306	0,98
4.315	Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig am 31.07.2026	4.364	Gesamt Nettovermögen			
5.099	Uber Technologies Inc, 144A, 8,000 %, fällig am 01.11.2026	5.193			1.151.380 \$	100,00
4.080	Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 01.06.2027	3.958	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.			
11.180	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, fällig am 01.06.2028	11.367	144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 belaufen sich diese Wertpapiere auf 575.462.000 USD und machten 49,97 % des Nettovermögens aus.			
7.940	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.04.2027	7.462	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.			
7.500	Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig am 15.05.2025	7.495	ABKÜRZUNGEN:			
		316.899	Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.			
		27,52	REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit			
			AUD – Australischer Dollar			
			BRL – Brasilianischer Real			
			COP – Kolumbianischer Peso			
			EUR – Euro			
			GBP – Britisches Pfund Sterling			
			MXN – Mexikanischer Peso			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,08
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	0,46
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,74
Finanzderivate	0,53
Sonstige Vermögenswerte	2,19
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2025	3.390	\$ -59
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Verkauf	20. Juni 2026	15.700	-663
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2025	1.605	-28
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2025	1.605	-420
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2025	3.495	-915
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1.309 \$)				\$ -
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -878 \$)				-2.085
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 431 \$)				\$ -2.085

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 154	Verkauf BRL 767	\$ -
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf BRL 68	Verkauf USD 14	-
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf BRL 699	Verkauf USD 142	-2
8. März 2024	Citi	Kauf USD 31.690	Verkauf GBP 25.290	-235
8. März 2024	JP Morgan	Kauf USD 57.600	Verkauf GBP 45.590	49
8. März 2024	UBS	Kauf GBP 16.860	Verkauf USD 21.416	-132
12. März 2024	Barclays	Kauf CHF 50.570	Verkauf USD 58.855	-1.596
12. März 2024	HSBC	Kauf CHF 49.460	Verkauf USD 57.529	-1.527
12. März 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 115.734	Verkauf CHF 100.030	2471
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 15	Verkauf CNH 112	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD -	Verkauf CZK 1	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 7.358	Verkauf EUR 6.827	-23
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 2.034	Verkauf EUR 1.875	4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 16	Verkauf GBP 13	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 108	Verkauf GBP 85	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 196	Verkauf SGD 264	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 483	Verkauf SGD 648	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CZK 795	Verkauf USD 34	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 368.731	Verkauf USD 396.727	2.054
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 2	Verkauf USD 3	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CZK 12	Verkauf USD -	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD 34	Verkauf USD 26	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 27.031	Verkauf USD 34.000	123
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK 25.218	Verkauf USD 2.392	42
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD 77.113	Verkauf USD 57.446	-98
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 2.468	Verkauf USD 2.674	-5
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNH 9.060	Verkauf USD 1.261	-3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD 6.571	Verkauf USD 4.286	-13
15. März 2024	HSBC	Kauf USD 23.608	Verkauf JPY 3.349.000	1.215
15. März 2024	JP Morgan	Kauf JPY 3.349.000	Verkauf USD 23.504	-1.111
02. Apr. 2024	BNY Mellon	Kauf BRL 771	Verkauf USD 155	-
19. Apr. 2024	HSBC	Kauf USD 3.341	Verkauf BRL 16.370	65
7. Mai 2024	HSBC	Kauf EUR 2.020	Verkauf USD 2.185	4
7. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD 31.580	Verkauf EUR 29.050	92
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 3.510 \$)				\$ 6.119
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 12.389 \$)				-4.746
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -8.879 \$)				\$ 1.373

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ minderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Citi	118	\$ 16.982	\$ -274
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Citi	656	74.897	55
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)				\$ 55
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.704 \$)				-274
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.704 \$)				\$ -219

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 28,85 % (28. Februar 2023: 81,49 %)					
876 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, Series 2019 R04, Class 2B1, 144A, 10,686 %, fällig am 25.06.2039 *	934	5,70	230 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875 %, fällig am 15.07.2028	243	1,48
547 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 9,536 %, fällig am 25.07.2039 *	570	3,47	340 IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig am 15.06.2025	341	2,08
570 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 8,686 %, fällig am 25.01.2040 *	587	3,58	250 KeyBank NA/Cleveland OH, Series BKNT, 5,674 %, fällig am 14.06.2024 *	249	1,52
826 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Series 2020 DNA3, Class B1, 144A, 10,536 %, fällig am 25.06.2050 *	911	5,55	200 Level 3 Financing Inc, 144A, 10,500 %, fällig am 15.05.2030	206	1,26
347 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA4, Series 2020 DNA4, Class B1, 144A, 11,436 %, fällig am 25.08.2050 *	396	2,41	230 MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig am 15.06.2028	222	1,35
330 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Series 2021 DNA7, Class B1, 144A, 8,972 %, fällig am 25.11.2041 *	341	2,08	220 Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, fällig am 01.02.2026	208	1,27
870 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA1, Series 2023 DNA1, Class B1, 144A, 13,472 %, fällig am 25.03.2043 *	993	6,06	95 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 30.09.2026	92	0,56
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 4.570 \$)	4.732	28,85	140 New York Community Bancorp Inc, 8,332 %, fällig am 06.11.2028 *	117	0,71
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 62,22 % (28. Februar 2023: 7,23 %)					
Argentinien – 2,58 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
220 YPF SA, 8,500 %, fällig am 28.07.2025	215	1,31	250 NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp, 144A, 8,125 %, fällig am 15.02.2029	222	1,35
209 YPF SA, 9,000 %, fällig am 12.02.2026	209	1,27	165 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.11.2029	152	0,92
	424	2,58	230 Sabre Global Inc, 144A, 8,625 %, fällig am 01.06.2027	203	1,24
Australien – 1,28 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
200 Mineral Resources Ltd, 144A, 9,250 %, fällig am 01.10.2028	210	1,28	210 SITO Royalties Operating Partnership LP / SITO Finance Corp, 144A, 7,875 %, fällig am 01.11.2028	215	1,31
Brasilien – 4,04 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
220 3R Lux SARL, 144A, 9,750 %, fällig am 05.02.2031	228	1,39	90 Star Parent Inc, 144A, 9,000 %, fällig am 01.10.2030	95	0,58
200 Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 8,500 %, fällig am 12.01.2031	196	1,20	200 Transocean Titan Financing Ltd, 144A, 8,375 %, fällig am 01.02.2028	205	1,25
200 CSN Resources SA, 144A, 8,875 %, fällig am 05.12.2030	205	1,25	130 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig am 15.04.2029	121	0,74
35 ERO Copper Corp, 144A, 6,500 %, fällig am 15.02.2030	33	0,20	220 Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 01.06.2027	213	1,30
	662	4,04	240 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 01.02.2029	220	1,34
Kanada – 4,05 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
180 Greenfire Resources Ltd, 144A, 12,000 %, fällig am 01.10.2028	189	1,15	210 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, fällig am 01.06.2028	213	1,30
260 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	256	1,57	220 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.04.2027	207	1,26
230 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2029	219	1,33		6.323	38,54
	664	4,05	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 9.883 \$)		
Chile – 1,36 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
240 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 144A, 4,050 %, fällig am 27.04.2026	223	1,36	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 6,85 % (28. Februar 2023: 4,43 %)		
Kolumbien – 1,55 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
240 Ecopetrol SA, 8,625 %, fällig am 19.01.2029	255	1,55	Brasilien – 0,97 % (28. Februar 2023: 1,90 %)		
Israel – 3,25 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
230 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig am 30.03.2026	216	1,32	BRL 800 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig am 01.01.2029	158	0,97
220 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, fällig am 30.06.2025	216	1,32	Kolumbien – 2,82 % (28. Februar 2023: 1,72 %)		
95 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 30.06.2027	91	0,56	COP 765.000 Colombian TES, Series B, 7,250 %, fällig am 18.10.2034	161	0,98
10 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig am 30.06.2030	9	0,05	COP 1.670.000 Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050	302	1,84
	532	3,25		463	2,82
Jersey – 1,24 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
200 Aston Martin Capital Holdings Ltd, 144A, 10,500 %, fällig am 30.11.2025	203	1,24	Ägypten – 1,10 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Mexiko – 3,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
200 Braskem Idesa SAPI, 6,990 %, fällig am 20.02.2032	144	0,88	200 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 6,588 %, fällig am 21.02.2028	181	1,10
130 Grupo Posadas SAB de CV, 7,000 %, fällig am 30.12.2027	115	0,70	Mexiko – 1,96 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
270 Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig am 12.02.2028	235	1,43	MXN 6.100 Mexikanische Bonos, Series M, 7,500 %, fällig am 26.05.2033	322	1,96
	494	3,01	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.124 \$)		
Vereinigtes Königreich – 1,32 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
220 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 6,750 %, fällig am 01.10.2026	216	1,32	Schuldscheindarlehen – 4,06 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
USA – 38,54 % (28. Februar 2023: 6,78 %)					
230 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig am 15.12.2027	212	1,29	120 Cotiviti Inc, 0,000 %, fällig am 24.02.2031 *	120	0,73
240 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig am 15.08.2027	234	1,43	240 Prairie ECI Acquiror LP, 0,000 %, fällig am 01.08.2029 *	238	1,45
220 Ameritex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 10,250 %, fällig am 15.10.2028	231	1,41	310 Westjet Airlines, 0,000 %, fällig am 31.01.2031 *	308	1,88
110 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 15.08.2028	95	0,58	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 663 \$)		
230 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 4,125 %, fällig am 15.08.2026	212	1,29		666	4,06
220 Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig am 15.12.2025	210	1,28	Organismen für gemeinsame Anlagen – 7,70 % (28. Februar 2023: 4,74 %)		
200 CSC Holdings LLC, 144A, 5,500 %, fällig am 15.04.2027	180	1,09	1.264 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.264	7,70
200 DISH Network Corp, 144A, 11,750 %, fällig am 15.11.2027	209	1,27	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.264 \$)		
195 Embecta Corp, 144A, 5,000 %, fällig am 15.02.2030	156	0,95	Stammaktien – 0,07 % (28. Februar 2023: 0,05 %)		
310 Freedom Mortgage Corp, 7,625 %, fällig am 01.05.2026	308	1,88	USA – 0,07 % (28. Februar 2023: 0,05 %)		
240 Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig am 15.01.2027	229	1,40	8 Danimer Scientific Inc	11	0,07
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
				18.003	109,75
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
				18003	109,75
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten					
				-1.600	-9,75
Gesamtnettovermögen					
				16.403 \$	100,00
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 12.879.000 USD und machten 78,53 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.					
ABKÜRZUNGEN:					
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit				
BRL	– Brasilianischer Real				
COP	– Kolumbianischer Peso				
MXN	– Mexikanischer Peso				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	71,04
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	2,94
Organismen für gemeinsame Anlagen	5,59
Sonstige Vermögenswerte	20,43
Gesamtvermögen	100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 20,08 % (28. Februar 2023: 13,31 %)		
1.508 Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig am 01.09.2052	1.429	2,01
459 Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, fällig am 10.01.2052	445	0,63
1.109 Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, fällig am 12.01.2052	1.077	1,52
1.247 Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	1.237	1,74
533 Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, fällig am 08.01.2052	517	0,73
1.092 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig am 09.01.2052	1.034	1,46
707 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, fällig am 10.01.2052	670	0,94
570 Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, fällig am 11.01.2052	553	0,78
1.740 Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	1.726	2,43
844 Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, fällig am 20.02.2053	840	1,18
1.537 Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	1.528	2,15
1.075 Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig am 20.05.2053	1.069	1,50
1.284 Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, fällig am 20.06.2053	1.255	1,77
888 Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, fällig am 20.06.2053	883	1,24
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 14.402 \$)	14.263	20,08
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 8,95 % (28. Februar 2023: 7,90 %)		
Australien – 2,08 % (28. Februar 2023: 4,12 %)		
1.470 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 6,094 %, fällig am 14.03.2025 *	1.477	2,08
Mexiko – 3,04 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
3.390 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig am 28.01.2060	2.162	3,04
USA – 3,83 % (28. Februar 2023: 3,78 %)		
1.420 General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig am 06.04.2026	1.421	2,00
1.310 Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig am 18.05.2026	1.297	1,83
	2.718	3,83
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.337 \$)	6.357	8,95
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 60,51 % (28. Februar 2023: 73,60 %)		
Brasilien – 12,09 % (28. Februar 2023: 11,00 %)		
BRL 24.470 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig am 01.01.2029	4.847	6,82
BRL 19.180 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	3.740	5,27
	8.587	12,09
Kolumbien – 9,82 % (28. Februar 2023: 7,24 %)		
COP 11.100.000 Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, fällig am 28.04.2028	2.538	3,57
COP 20.590.000 Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig am 30.06.2032	4.436	6,25
	6.974	9,82
Tschechische Republik – 4,74 % (28. Februar 2023: 4,84 %)		
CZK 91.690 Tschechische Republik, Staatsanleihe, Serie 138, 1,750 %, fällig am 23.06.2032	3.365	4,74
Mexiko – 16,75 % (28. Februar 2023: 20,07 %)		
MXN 36.400 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 18.11.2038	2.016	2,84
MXN 155.500 Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	7.890	11,10
MXN 38.800 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	1.995	2,81
	11.901	16,75
Südafrika – 7,13 % (28. Februar 2023: 8,58 %)		
ZAR 33.800 Staatsanleihe Republik Südafrika, Series R214, 6,500 %, fällig am 28.02.2041	1.048	1,47
ZAR 106.700 Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig am 28.02.2048	4.020	5,66
	5.068	7,13

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung von Kontrakten (in Tsd.)
6. März 2024	JP Morgan	Kauf USD	1.597 Verkauf AUD	\$ -3
6. März 2024	JP Morgan	Kauf AUD	2.460 Verkauf USD	-42
8. März 2024	JP Morgan	Kauf USD	177 Verkauf GBP	-
8. März 2024	JP Morgan	Kauf GBP	5.650 Verkauf USD	-6
11. März 2024	Barclays	Kauf INR	182.000 Verkauf USD	17
12. März 2024	Barclays	Kauf CHF	470 Verkauf USD	-6
12. März 2024	Goldman Sachs	Kauf USD	19.023 Verkauf CHF	363
13. März 2024	Citi	Kauf KRW	3.060.000 Verkauf USD	-39
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD	102 Verkauf USD	76
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	3 Verkauf USD	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD	108.928 Verkauf USD	-210
15. März 2024	JP Morgan	Kauf JPY	2.584.000 Verkauf USD	-857
15. März 2024	UBS	Kauf USD	451 Verkauf JPY	3
12. Apr. 2024	Barclays	Kauf NZD	6.690 Verkauf USD	-93
12. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf USD	166 Verkauf NZD	1
18. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf USD	124 Verkauf NOK	1
18. Apr. 2024	Morgan Stanley	Kauf NOK	33.500 Verkauf USD	-113

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
USA – 9,98 % (28. Februar 2023: 12,74 %)		
7.080 United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025 *	7.089	9,98
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 43.880 \$)	42.984	60,51
Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,62 % (28. Februar 2023: 5,60 %)		
30 Franklin Templeton Global Funds Plc – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund – LM Class US\$ Accumulating	3.994	5,62
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.500 \$)	3.994	5,62
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 68.119 \$)		
	67.598	95,16
Devisenterminkontrakte – 0,61 % (28. Februar 2023: 0,36 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	430	0,61
Futures – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	14	0,02
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	68.042	95,79
Devisenterminkontrakte – -2,06 % (28. Februar 2023: 5,02 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.463	-2,06
Futures – -0,24 % (28. Februar 2023: 0,41 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-167	-0,24
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-1.630	-2,30
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	66.412	93,49
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	4.625	6,51
Gesamtnettovermögen	71.037 \$	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %

144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.477.000 USD und machten 2,08 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.

ABKÜRZUNGEN:

BRL	–	Brasilianischer Real
COP	–	Kolumbianischer Peso
CZK	–	Tschechische Krone
MXN	–	Mexikanischer Peso
ZAR	–	Südafrikanischer Rand

Verteilung des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens		
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				86,96
Organismen für gemeinsame Anlagen				5,46
Finanzderivate				0,61
Sonstige Vermögenswerte				6,97
Gesamtvermögen		100,00		

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
23. Apr. 2024	Barclays	Kauf	MYR 7.900	Verkauf	USD 1.687	\$ -20
23. Apr. 2024	Citi	Kauf	MXN 34.800	Verkauf	USD 2.000	24
23. Apr. 2024	Goldman Sachs	Kauf	USD 185	Verkauf	MXN 3.200	-1
25. Apr. 2024	Citi	Kauf	CAD 9.670	Verkauf	USD 7.167	-35
25. Apr. 2024	UBS	Kauf	USD 238	Verkauf	CAD 320	2
30. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	USD 2.182	Verkauf	COP 8.770.000	-30
30. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf	COP 680.000	Verkauf	USD 171	-
10. Mai 2024	Barclays	Kauf	THB 80.700	Verkauf	USD 2.264	-
10. Mai 2024	HSBC	Kauf	USD 2.255	Verkauf	THB 80.700	-8
15. Mai 2024	HSBC	Kauf	USD 538	Verkauf	ZAR 10.300	5
16. Mai 2024	Citi	Kauf	USD 3.388	Verkauf	CZK 79.200	11
16. Mai 2024	Morgan Stanley	Kauf	CZK 2.600	Verkauf	USD 111	-
6. Juni 2024	JP Morgan	Kauf	AUD 2.460	Verkauf	USD 1.601	3
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 249 \$)						\$ 430
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.482 \$)						-1.463
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.233 \$)						\$ -1.033

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Morgan Stanley	67	\$ 9.642	\$ -167
Long Gilt Juni 2024	Morgan Stanley	40	4.953	14
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): - \$)				\$ 14
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -283 \$)				-167
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -283 \$)				\$ -153

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 15,34 % (28. Februar 2023: 18,58 %)			Gesundheit – Dienstleistungen – 1,41 % (28. Februar 2023: 2,03 %)			
60	66	0,42	79	78	0,49	
				145	0,92	
170	181	1,14		223	1,41	
145	152	0,96	Investmentgesellschaften – 0,76 % (28. Februar 2023: 2,59 %)			
167	169	1,07	130	120	0,76	
185	185	1,17	Bergbau – 3,61 % (28. Februar 2023: 3,46 %)			
160	161	1,01	35	33	0,21	
80	82	0,52	220	209	1,32	
600	605	3,82	175	157	0,99	
65	67	0,43		173	1,09	
70	75	0,47		572	3,61	
40	42	0,27	Multinational – 2,73 % (28. Februar 2023: 3,87 %)			
185	209	1,32	MXN	4.040	215	1,36
135	144	0,91	BRL	1.150	218	1,37
40	44	0,28		433	2,73	
112	114	0,72	Öl u. Gas – 7,44 % (28. Februar 2023: 8,11 %)			
38	39	0,24	150	151	0,95	
90	94	0,59	60	63	0,40	
			120	113	0,71	
			90	81	0,51	
			35	34	0,21	
			100	98	0,62	
			140	137	0,87	
			140	143	0,91	
			200	201	1,27	
			165	157	0,99	
				1.178	7,44	
			Verpackung u. Behälter – 0,50 % (28. Februar 2023: 2,04 %)			
			90	80	0,50	
			Pipelines – 2,25 % (28. Februar 2023: 1,98 %)			
			205	198	1,25	
			155	158	1,00	
				356	2,25	
			Halbleiter – 1,22 % (28. Februar 2023: 1,21 %)			
			235	193	1,22	
			Transport – 1,29 % (28. Februar 2023: 1,25 %)			
			EUR	220	204	1,29
			Wasser – 0,95 % (28. Februar 2023: 1,00 %)			
			150	150	0,95	
			Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 5.856 \$)			
				5.965	37,68	
			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 43,33 % (28. Februar 2023: 10,56 %)			
			Staatspapiere – 43,33 % (28. Februar 2023: 10,56 %)			
			BRL	1.840	370	2,34
			BRL	780	154	0,98
			COP	2.868.000	638	4,03
			COP	1.671.000	302	1,91
			MXN	10.500	554	3,50
			MXN	6.400	325	2,05
			EUR	650	470	2,97
			GBP	820	901	5,69
				3.140	3.144	19,86
					6.858	43,33
			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.592 \$)			
				6.858	43,33	
			Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,66 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			
			579	579	3,66	
			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 579 \$)			
				579	3,66	
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 15.413 \$)			
				15.831	100,01	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 37,68 % (28. Februar 2023: 59,55 %)			Fluggesellschaften – 1,38 % (28. Februar 2023: 1,76 %)			
116	113	0,71	116	113	0,71	
105	105	0,67	105	105	0,67	
	218	1,38		218	1,38	
Automobilhersteller – 3,49 % (28. Februar 2023: 4,84 %)			Banken – 5,79 % (28. Februar 2023: 7,54 %)			
190	190	1,20	155	152	0,96	
185	163	1,03	200	198	1,25	
EUR	199	1,26	130	161	1,02	
	552	3,49	220	210	1,33	
			200	196	1,23	
				917	5,79	
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 1,33 % (28. Februar 2023: 3,70 %)			Strom – 1,25 % (28. Februar 2023: 1,42 %)			
225	210	1,33	236	198	1,25	
Energie – Alternative Quellen – 1,20 % (28. Februar 2023: 1,17 %)			Energie – Alternative Quellen – 1,20 % (28. Februar 2023: 1,17 %)			
EUR	205	1,20	205	190	1,20	
Nahrungsmittel – 1,08 % (28. Februar 2023: 3,42 %)			Nahrungsmittel – 1,08 % (28. Februar 2023: 3,42 %)			
GBP	135	1,08	135	171	1,08	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Devisenterminkontrakte – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,58 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	54	0,34
Futures – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	15.886	100,35
Devisenterminkontrakte – -0,36 % (28. Februar 2023: 0,43 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-57	-0,36
Futures – -0,02 % (28. Februar 2023: 0,83 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-4	-0,02
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-61	-0,38
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	15.825	99,97
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	4	0,03
Gesamt Nettovermögen		
	15.829 \$	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.761.000 \$ und machten 36,38 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.

ABKÜRZUNGEN:

REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit
BRL	– Brasilianischer Real
COP	– Kolumbianischer Peso
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
MXN	– Mexikanischer Peso

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,24
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,58
Finanzderivate	0,34
Sonstige Vermögenswerte	1,84
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
8. März 2024	Citi	Kauf USD 439	Verkauf GBP 350	\$ -3
8. März 2024	JP Morgan	Kauf USD 1.200	Verkauf GBP 950	1
8. März 2024	UBS	Kauf GBP 330	Verkauf USD 419	-2
12. März 2024	Barclays	Kauf CHF 560	Verkauf USD 652	-18
12. März 2024	HSBC	Kauf CHF 580	Verkauf USD 675	-18
12. März 2024	Morgan Stanley	Kauf USD 1.319	Verkauf CHF 1.140	28
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 21	Verkauf USD 26	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 95	Verkauf USD 103	1
15. März 2024	HSBC	Kauf USD 317	Verkauf JPY 45.000	16
15. März 2024	JP Morgan	Kauf JPY 45.000	Verkauf USD 316	-15
19. Apr. 2024	HSBC	Kauf USD 227	Verkauf BRL 1.110	4
29. Apr. 2024	JP Morgan	Kauf USD 156	Verkauf MXN 2.700	-1
7. Mai 2024	HSBC	Kauf EUR 40	Verkauf USD 43	–
7. Mai 2024	JP Morgan	Kauf USD 1.272	Verkauf EUR 1.170	4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 86 \$)				\$ 54
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -64 \$)				-57
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 22 \$)				\$ -3

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2024	Citi	2	\$ 288	\$ -4
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Citi	9	1.027	1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)				\$ 1
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -123 \$)				-4
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -123 \$)				\$ -3

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 42,78 %			Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,28 %		
1.303 Fannie Mae Pool 'MA4806', 5,000 %, fällig am 11.01.2052	1.265	3,99	1.040 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.040	3,28
637 Fannie Mae Pool 'MA4869', 5,500 %, fällig am 01.01.2053	631	1,99	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.040 \$)	1.040	3,28
164 Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	163	0,51	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 30.263 \$)	30.675	96,77
818 Ginnie Mae II Pool 'MA8647', 5,000 %, fällig am 20.02.2053	801	2,53	Futures – 0,05 %		
469 Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, fällig am 20.02.2053	467	1,47	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	14	0,05
1.146 Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	1.139	3,59	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	30.689	96,82
1.017 Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig am 20.05.2053	1.011	3,19	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	30.689	96,82
490 Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, fällig am 20.06.2053	479	1,51	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	1.010	3,18
703 Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, fällig am 20.06.2053	699	2,21	Gesamtvermögen	31.699 \$	100,00
720 Ginnie Mae II Pool 'MA9106', 5,500 %, fällig am 20.08.2053	715	2,26	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
1.591 Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, fällig am 20.09.2053	1.582	4,99	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.		
1.587 Ginnie Mae II Pool 'MA9241', 5,500 %, fällig am 20.10.2053	1.577	4,98			
1.114 Ginnie Mae II Pool 'MA9305', 5,500 %, fällig am 20.11.2053	1.107	3,49	Verteilung des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
1.406 Ginnie Mae II Pool 'MA9362', 5,500 %, fällig am 20.12.2053	1.397	4,41	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		92,78
530 Ginnie Mae II Pool 'MA9488', 5,500 %, fällig am 20.02.2054	527	1,66	Organismen für gemeinsame Anlagen		3,26
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 13.356 \$)	13.560	42,78	Finanzderivate		0,04
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 5,55 %			Sonstige Vermögenswerte		3,92
USA – 5,55 %			Gesamtvermögen		100,00
260 Dell International LLC / EMC Corp, 3,375 %, fällig am 15.12.2041	190	0,60			
70 Devon Energy Corp, 7,875 %, fällig am 30.09.2031	80	0,25			
320 Diamondback Energy Inc, 6,250 %, fällig am 15.03.2033	336	1,06			
320 Equinix Inc, 2,500 %, fällig am 15.05.2031	267	0,84			
300 Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, fällig am 24.08.2026	274	0,86			
620 Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig am 18.05.2026	614	1,94			
	1.761	5,55			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.707 \$)	1.761	5,55			
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 45,16 %					
USA – 45,16 %					
290 United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,501 %, fällig am 31.10.2025 *	290	0,92			
8790 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 29.02.2028	8.683	27,39			
4550 United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig am 31.10.2028	4.662	14,71			
700 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	679	2,14			
	14.314	45,16			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 14.160 \$)	14.314	45,16			

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2024	Citi	76	\$ 8677
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2024	Citi	44	4704
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2024	Citi	33	4220
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten			\$ 14
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten			–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten			\$ 14

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Value Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 96,91 % (28. Februar 2023: 99,17 %)			Maschinen – Diversifiziert – 1,87 % (28. Februar 2023: 1,57 %)		
Bekleidung – 1,63 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			721 CNH Industrial NV 8.611 0,74		
397 Tapestry Inc	18.886	1,63	308 Flowserve Corp	13.034	1,13
Banken – 6,31 % (28. Februar 2023: 10,33 %)			21.645 1,87		
898 Bank of America Corp	30.952	2,68	Bergbau – 2,17 % (28. Februar 2023: 5,43 %)		
1.410 First Horizon Corp	19.824	1,71	666 Freeport-McMoRan Inc 25.169 2,17		
57 Goldman Sachs Group Inc/The	22.260	1,92	Fertigung diverse – 1,90 % (28. Februar 2023: 1,21 %)		
	73.036	6,31	EUR 111 Siemens AG 21.934 1,90		
Getränke – 1,22 % (28. Februar 2023: 1,17 %)			Öl u. Gas – 7,51 % (28. Februar 2023: 9,97 %)		
57 Constellation Brands Inc 'A'	14.175	1,22	521 EQT Corp 19.317 1,67		
Biotechnologie – 4,75 % (28. Februar 2023: 5,57 %)			175 Hess Corp 25.547 2,21		
33 Argenx SE ADR	12.550	1,08	562 Noble Corp Plc 23.493 2,03		
63 Biogen Inc	13.621	1,18	289 TotalEnergies SE ADR 86.898 7,51		
120 BioNTech SE ADR	10.676	0,92	Öl- u. Gasdienstleistungen – 1,42 % (28. Februar 2023: 3,46 %)		
252 Gilead Sciences Inc	18.161	1,57	557 Baker Hughes Co 'A' 16.456 1,42		
	55.008	4,75	Pharma – 6,75 % (28. Februar 2023: 4,16 %)		
Chemie – 1,70 % (28. Februar 2023: 2,02 %)			113 AbbVie Inc 19.874 1,72		
224 Eastman Chemical Co	19.681	1,70	232 CVS Health Corp 17.211 1,48		
Kohle – 1,02 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			255 Johnson & Johnson 41.107 3,55		
307 Teck Resources Ltd	11.784	1,02	78.192 6,75		
Gewerbliche Dienstleistungen – 2,11 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Pipelines – 0,83 % (28. Februar 2023: 1,90 %)		
290 Block Inc	23.002	1,99	281 Enbridge Inc 9.661 0,83		
104 R1 RCM Inc	1.460	0,12	Immobilien – 0,77 % (28. Februar 2023: 0,86 %)		
	24.462	2,11	117 Howard Hughes Holdings Inc 8.902 0,77		
Kosmetik u. Körperpflege – 1,10 % (28. Februar 2023: 2,71 %)			Einzelhandel – 1,13 % (28. Februar 2023: 0,78 %)		
1.017 Coty Inc	12.763	1,10	86 Target Corp 13.061 1,13		
Distribution u. Großhandel – 1,41 % (28. Februar 2023: 1,10 %)			Halbleiter – 3,77 % (28. Februar 2023: 2,44 %)		
JPY 982 Marubeni Corp	16.302	1,41	216 Marvell Technology Inc 15.444 1,34		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 5,19 % (28. Februar 2023: 2,60 %)			311 Micron Technology Inc 28.170 2,43		
228 Apollo Global Management Inc	25.476	2,20	43.614 3,77		
166 Capital One Financial Corp	22.863	1,98	Software – 5,75 % (28. Februar 2023: 5,91 %)		
249 OneMain Holdings Inc	11.744	1,01	168 Fiserv Inc 25.075 2,17		
	60.083	5,19	39 Microsoft Corp 16.163 1,40		
Strom – 8,30 % (28. Februar 2023: 6,47 %)			226 Oracle Corp 25.271 2,18		
999 AES Corp/The	15.184	1,31	66.509 5,75		
112 Constellation Energy Corp	18.896	1,63	Transport – 4,68 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
226 NextEra Energy Inc	12.468	1,08	140 Canadian Pacific Kansas City Ltd 11.892 1,03		
725 PPL Corp	19.122	1,65	78 Union Pacific Corp 19.694 1,70		
559 Vistra Corp	30.456	2,63	152 United Parcel Service Inc 'B' 22.537 1,95		
	96.126	8,30	54.123 4,68		
Elektronik – 1,19 % (28. Februar 2023: 1,32 %)			Wasser – 0,98 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
81 Atkore Inc	13.718	1,19	GBP 875 United Utilities Group Plc 11.325 0,98		
Energie – 1,74 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 947.434 \$)		
179 ConocoPhillips	20.121	1,74	1.121.875 96,91		
Energie – Alternative Quellen – 0,71 % (28. Februar 2023: 1,79 %)			Real Estate Investment Trusts – 1,75 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
541 Fluence Energy Inc	8.272	0,71	REITS – 1,75 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Umweltkontrolle – 1,25 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			102 American Tower Corp 20.260 1,75		
80 Clean Harbors Inc	14.473	1,25	Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 19.062 \$)		
Nahrungsmittel – 2,08 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			20.260 1,75		
238 Kellanova	13.095	1,13	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
143 Performance Food Group Co	10.936	0,95	bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 966.496 \$)		
	24.031	2,08	1.142.135 98,66		
Gesundheit – Dienstleistungen – 1,11 % (28. Februar 2023: 2,09 %)			Devisenterminkontrakte – 0,05 %		
40 ICON Plc	12.859	1,11	(28. Februar 2023: 0,00 %)		
Versicherungen – 7,89 % (28. Februar 2023: 7,60 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 622 0,05		
445 American International Group Inc	32.419	2,80	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten		
783 Corebridge Financial Inc	19.426	1,68	finanziellen Vermögenswerte		
50 Everest Group Ltd	18.566	1,60	1.142.757 98,71		
1.054 MGIC Investment Corp	20.954	1,81	Devisenterminkontrakte – 0,00 %		
	91.365	7,89	(28. Februar 2023: -0,10 %)		
Internet – 5,60 % (28. Februar 2023: 6,89 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -6 -		
111 Expedia Group Inc	15.223	1,31	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten		
55 Meta Platforms Inc 'A'	27.034	2,34	finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
285 Uber Technologies Inc	22.596	1,95	1.142.751 98,71		
	64.853	5,60	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
Unterkünfte – 1,07 % (28. Februar 2023: 2,97 %)			14.875 1,29		
227 Las Vegas Sands Corp	12.388	1,07	Gesamtnettovermögen		
			1.157.626 \$ 100,00		

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

FTGF ClearBridge Value Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
JPY	– Japanischer Yen

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,86
Finanzderivate	0,05
Sonstige Vermögenswerte	2,09
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)		
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	841	Verkauf	EUR	781	\$ -3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	10.088	Verkauf	EUR	9.313	17
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	38	Verkauf	SGD	49	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	21	Verkauf	SGD	28	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	1	Verkauf	USD	1	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	2.133	Verkauf	USD	1.589	-2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	110.672	Verkauf	USD	119.085	605
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	198	Verkauf	USD	214	-1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 10 \$)							\$	622
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -976 \$)								-6
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -966 \$)							\$	616

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 98,28 % (28. Februar 2023: 93,97 %)			Öl u. Gas – 1,16 % (28. Februar 2023: 1,53 %)		
Banken – 5,08 % (28. Februar 2023: 5,28 %)			10 Pioneer Natural Resources Co 2.447 1,16		
84 Bank of America Corp	2.889	1,36	Verpackung u. Behälter – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,65 %)		
30 JPMorgan Chase & Co	5.601	2,65	19 Crown Holdings Inc 1.423 0,67		
54 US Bancorp	2.259	1,07	Pharma – 9,39 % (28. Februar 2023: 9,05 %)		
	10.749	5,08	18 AbbVie Inc 3.075 1,45		
Getränke – 2,29 % (28. Februar 2023: 2,85 %)			9 Becton Dickinson & Co 2.197 1,04		
37 Coca-Cola Co/The	2.212	1,05	6 Eli Lilly & Co 4.711 2,23		
16 PepsiCo Inc	2.630	1,24	25 Johnson & Johnson 4.053 1,92		
	4.842	2,29	46 Merck & Co Inc 5.817 2,75		
Baumaterialien – 1,03 % (28. Februar 2023: 0,85 %)			19.853 9,39		
8 Vulcan Materials Co	2.169	1,03	Pipelines – 0,70 % (28. Februar 2023: 0,73 %)		
Chemie – 3,50 % (28. Februar 2023: 4,64 %)			86 Kinder Morgan Inc 1.488 0,70		
8 Ecolab Inc	1.759	0,83	Einzelhandel – 5,30 % (28. Februar 2023: 5,87 %)		
3 Linde Plc	1.132	0,54	2 Costco Wholesale Corp 1.583 0,75		
18 PPG Industries Inc	2.607	1,23	6 Home Depot Inc/The 2.171 1,02		
6 Sherwin-Williams Co/The	1.895	0,90	49 TJX Cos Inc/The 4.821 2,28		
	7.393	3,50	45 Walmart Inc 2.636 1,25		
Gewerbliche Dienstleistungen – 1,72 % (28. Februar 2023: 2,23 %)			11.211 5,30		
15 Automatic Data Processing Inc	3.640	1,72	Halbleiter – 5,32 % (28. Februar 2023: 1,79 %)		
Computer – 5,17 % (28. Februar 2023: 5,41 %)			3 ASML Holding NV 2.964 1,40		
61 Apple Inc	10.937	5,17	17 Intel Corp 718 0,34		
Kosmetik u. Körperpflege – 1,39 % (28. Februar 2023: 1,47 %)			15 Marvell Technology Inc 1.073 0,51		
19 Procter & Gamble Co/The	2.947	1,39	8 NVIDIA Corp 6.504 3,07		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 5,03 % (28. Februar 2023: 4,58 %)			11.259 5,32		
9 CME Group Inc	1.907	0,90	Software – 12,46 % (28. Februar 2023: 9,29 %)		
16 Intercontinental Exchange Inc	2.236	1,06	6 Adobe Inc 3.289 1,56		
23 Visa Inc 'A'	6.483	3,07	46 Microsoft Corp 19.011 8,99		
	10.626	5,03	26 Oracle Corp 2.940 1,39		
Elektrik – 1,06 % (28. Februar 2023: 1,27 %)			2 Synopsys Inc 1.103 0,52		
16 NextEra Energy Inc	862	0,41	26.343 12,46		
20 Sempra	1.388	0,65	Telekommunikation – 1,42 % (28. Februar 2023: 2,55 %)		
	2.250	1,06	7 Arista Networks Inc 1.866 0,89		
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 2,74 % (28. Februar 2023: 0,89 %)			7 T-Mobile US Inc 1.125 0,53		
9 Eaton Corp Plc	2.650	1,25	2.991 1,42		
30 Emerson Electric Co	3.151	1,49	Transport – 2,32 % (28. Februar 2023: 2,88 %)		
	5.801	2,74	16 Canadian Pacific Kansas City Ltd 1.385 0,66		
Elektronik – 2,09 % (28. Februar 2023: 2,46 %)			5 Union Pacific Corp 1.292 0,61		
22 Honeywell International Inc	4.428	2,09	15 United Parcel Service Inc 'B' 2.226 1,05		
Umweltkontrolle – 1,89 % (28. Februar 2023: 1,68 %)			4.903 2,32		
19 Waste Management Inc	3.995	1,89	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 140.360 \$) 207.815 98,28		
Nahrungsmittel – 1,16 % (28. Februar 2023: 1,29 %)			Real Estate Investment Trusts – 1,12 % (28. Februar 2023: 1,32 %)		
4 McCormick & Co Inc/MD	281	0,13	REITs – 1,12 % (28. Februar 2023: 1,32 %)		
30 Mondelez International Inc	2.164	1,03	12 American Tower Corp 2.381 1,12		
	2.445	1,16	Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 2.230 \$) 2.381 1,12		
Gesundheit – Produkte – 2,79 % (28. Februar 2023: 3,08 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 210.196 99,40		
8 Stryker Corp	2.670	1,26	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 210.196 99,40		
6 Thermo Fisher Scientific Inc	3.225	1,53	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte 1.260 0,60		
	5.895	2,79	Gesamtnettovermögen 211.456 \$ 100,00		
Gesundheit – Dienstleistungen – 1,96 % (28. Februar 2023: 3,11 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
8 UnitedHealth Group Inc	4.151	1,96	Verteilung des Gesamtvermögens % des Gesamtvermögens		
Versicherungen – 8,08 % (28. Februar 2023: 7,66 %)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 98,99		
– Berkshire Hathaway Inc	8.018	3,79	Sonstige Vermögenswerte 1,01		
20 Hartford Financial Services Group Inc/The	1.959	0,93	Gesamtvermögen 100,00		
13 Progressive Corp/The	2.532	1,20			
21 Travelers Cos Inc/The	4.568	2,16			
	17.077	8,08			
Internet – 10,89 % (28. Februar 2023: 5,69 %)					
23 Alphabet Inc	3.261	1,54			
28 Alphabet Inc 'A'	3.865	1,83			
47 Amazon.com Inc	8.268	3,91			
9 Meta Platforms Inc 'A'	4.478	2,12			
5 Netflix Inc	3.151	1,49			
	23.023	10,89			
Medien – 1,67 % (28. Februar 2023: 1,98 %)					
53 Comcast Corp	2.271	1,07			
11 Walt Disney Co/The	1.258	0,60			
	3.529	1,67			

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 96,11 % (28. Februar 2023: 94,00 %)			Einzelhandel – 1,56 % (28. Februar 2023: 1,08 %)		
Bekleidung – 1,27 % (28. Februar 2023: 2,34 %)			192 Target Corp 29.268 1,56		
228 NIKE Inc	23.665	1,27	Halbleiter – 11,28 % (28. Februar 2023: 7,23 %)		
Automobilhersteller – 0,53 % (28. Februar 2023: 0,78 %)			41 ASML Holding NV 38.646 2,06		
49 Tesla Inc	9.867	0,53	433 Intel Corp 18.623 1,00		
Autoteile u. Ausstattung – 0,75 % (28. Februar 2023: 1,59 %)			194 NVIDIA Corp 153.866 8,22		
177 Aptiv Plc	14.066	0,75	211.135 11,28		
Getränke – 1,52 % (28. Februar 2023: 2,54 %)			Software – 16,82 % (28. Februar 2023: 15,08 %)		
483 Monster Beverage Corp	28.516	1,52	69 Adobe Inc 38.820 2,07		
Chemie – 1,87 % (28. Februar 2023: 1,40 %)			97 Atlassian Corp 20.048 1,07		
105 Sherwin-Williams Co/The	34.952	1,87	39 Intuit Inc 25.638 1,37		
Gewerbliche Dienstleistungen – 2,63 % (28. Februar 2023: 4,38 %)			373 Microsoft Corp 154.079 8,23		
308 PayPal Holdings Inc	18.576	0,99	148 Salesforce Inc 45.616 2,44		
72 S&P Global Inc	30.736	1,64	105 Workday Inc 'A' 30.814 1,64		
	49.312	2,63	315.015 16,82		
Computer – 3,91 % (28. Februar 2023: 4,50 %)			Transport – 2,39 % (28. Februar 2023: 2,09 %)		
405 Apple Inc	73.229	3,91	110 Union Pacific Corp 27.957 1,49		
Kosmetik u. Körperpflege – 1,26 % (28. Februar 2023: 1,77 %)			114 United Parcel Service Inc 'B' 16.852 0,90		
159 Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	23.583	1,26	44.809 2,39		
Distribution u. Großhandel – 2,52 % (28. Februar 2023: 2,87 %)			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.103.013 \$)		
48 WW Grainger Inc	47.199	2,52	1.799.726 96,11		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 5,29 % (28. Februar 2023: 5,87 %)			Real Estate Investment Trusts – 1,50 % (28. Februar 2023: 1,68 %)		
94 Intercontinental Exchange Inc	12.930	0,69	REITS – 1,50 % (28. Februar 2023: 1,68 %)		
305 Visa Inc 'A'	86.117	4,60	32 Equinix Inc 28.138 1,50		
	99.047	5,29	Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 16.028 \$)		
Elektrik – 0,85 % (28. Februar 2023: 0,97 %)			28.138 1,50		
289 NextEra Energy Inc	15.953	0,85	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.119.041 \$)		
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 2,34 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			1.827.864 97,61		
152 Eaton Corp Plc	43.869	2,34	Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,02 %)		
Elektronik – 1,44 % (28. Februar 2023: 2,13 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 392 0,02		
136 Honeywell International Inc	27.029	1,44	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Gesundheit – Produkte – 7,98 % (28. Februar 2023: 8,51 %)			1.828.256 97,63		
343 Alcon Inc	29.001	1,55	Devisenterminkontrakte – -0,02 % (28. Februar 2023: 0,12 %)		
102 Intuitive Surgical Inc	39.435	2,11	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -312 -0,02		
97 Stryker Corp	33.741	1,80	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
83 Thermo Fisher Scientific Inc	47.266	2,52	-312 -0,02		
	149.443	7,98	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Gesundheit – Dienstleistungen – 2,70 % (28. Februar 2023: 3,99 %)			1.827.944 97,61		
102 UnitedHealth Group Inc	50.449	2,70	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
Versicherungen – 1,40 % (28. Februar 2023: 1,78 %)			44.656 2,39		
130 Marsh & McLennan Cos Inc	26.210	1,40	Gesamtnettovermögen		
Internet – 22,55 % (28. Februar 2023: 16,25 %)			1.872.600 \$ 100,00		
826 Amazon.com Inc	145.878	7,79	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
237 Meta Platforms Inc 'A'	116.013	6,20	Verteilung des Gesamtvermögens		
120 Netflix Inc	72.001	3,84	% des Gesamtvermögens		
149 Palo Alto Networks Inc	46.216	2,47	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 96,40		
530 Uber Technologies Inc	42.090	2,25	Finanzderivate 0,02		
	422.198	22,55	Sonstige Vermögenswerte 3,58		
Pharma – 3,25 % (28. Februar 2023: 4,30 %)			Gesamtvermögen		
43 Eli Lilly & Co	32.135	1,71	100,00		
145 Zoetis Inc	28.777	1,54			
	60.912	3,25			

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 29.263	Verkauf BRL 145.490	\$ 9
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf BRL 140.886	Verkauf USD 28.607	-278
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf BRL 4.603	Verkauf USD 919	6
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 695	Verkauf EUR 641	2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 931	Verkauf EUR 864	-4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 68.815	Verkauf USD 74.046	375
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 14.958	Verkauf USD 16.200	-22
2. April 2024	BNY Mellon	Kauf BRL 149.723	Verkauf USD 30.021	-8
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 286 \$)				\$ 392
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.551 \$)				-312
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.265 \$)				\$ 80

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 98,91 % (28. Februar 2023: 95,22 %)			Software – 18,15 % (28. Februar 2023: 12,84 %)		
Getränke – 1,50 % (28. Februar 2023: 1,70 %)			50 Autodesk Inc 12.799 6,17		
21 Diageo Plc ADR	3.105	1,50	31 DocuSign Inc 'A'	1.650	0,80
Biotechnologie – 12,44 % (28. Februar 2023: 14,46 %)			57 Doximity Inc	1.604	0,77
20 Biogen Inc	4.302	2,08	16 HubSpot Inc	10.161	4,90
82 Ionis Pharmaceuticals Inc	3.692	1,78	5 MongoDB Inc 'A'	2.147	1,04
41 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	2.144	1,03	6 ServiceNow Inc	4.387	2,12
37 Vertex Pharmaceuticals Inc	15.657	7,55	26 Snowflake Inc	4.884	2,35
	25.795	12,44		37.632	18,15
Baumaterialien – 2,53 % (28. Februar 2023: 3,56 %)			Telekommunikation – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
89 Johnson Controls International plc	5.241	2,53	24 GCI Liberty, Inc. Escrow ∞	–	–
Gewerbliche Dienstleistungen – 1,79 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Transport – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
4 Cintas Corp	2.766	1,33	1 Old Dominion Freight Line Inc	310	0,15
6 Paylocity Holding Corp	945	0,46			
	3.711	1,79	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 132.574 \$)	205.138	98,91
Computer – 11,88 % (28. Februar 2023: 6,43 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 132.574 \$)		
13 Accenture Plc 'A'	4.973	2,40		205.138	98,91
46 CrowdStrike Holdings Inc	15.010	7,24	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
31 Seagate Technology Holdings Plc	2.851	1,37	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 7 –		
30 Western Digital Corp	1.808	0,87	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	24.642	11,88		205.145	98,91
Kosmetik u. Körperpflege – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Devisenterminkontrakte – -0,01 % (28. Februar 2023: -0,10 %)		
3 elf Beauty Inc	521	0,25	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -22 -0,01		
Distribution u. Großhandel – 1,08 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
2 WW Grainger Inc	2.244	1,08		-22	-0,01
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 0,74 % (28. Februar 2023: 0,67 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
21 Cohen & Steers Inc	1.530	0,74		205.123	98,90
Elektronik – 5,22 % (28. Februar 2023: 6,57 %)			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
76 TE Connectivity Ltd	10.837	5,22		2.267	1,10
Unterhaltung – 4,05 % (28. Februar 2023: 4,72 %)			Gesamtvermögen		
53 Madison Square Garden Entertainment Corp 'A'	2.032	0,98		207.390 \$	100,00
34 Madison Square Garden Sports Corp	6.379	3,07			
	8.411	4,05			
Gesundheit – Produkte – 1,07 % (28. Februar 2023: 2,10 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
14 Insulet Corp	2.225	1,07	∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.		
Gesundheit – Dienstleistungen – 7,81 % (28. Februar 2023: 9,41 %)			ABKÜRZUNGEN:		
16 Charles River Laboratories International Inc	4.161	2,01	ADR	–	American Depositary Receipt
24 UnitedHealth Group Inc	12.041	5,80			
	16.202	7,81	Verteilung des Gesamtvermögens		
Wohnungseinrichtungen – 1,48 % (28. Februar 2023: 1,46 %)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 98,58		
38 Dolby Laboratories Inc 'A'	3.077	1,48	Finanzderivate –		
Internet – 6,61 % (28. Februar 2023: 5,83 %)			Sonstige Vermögenswerte 1,42		
34 Airbnb Inc	5.371	2,59	Gesamtvermögen		
29 Etsy Inc	2.110	1,02			100,00
10 Match Group Inc	363	0,18			
3 Meta Platforms Inc 'A'	1.471	0,71			
120 Pinterest Inc	4.386	2,11			
	13.701	6,61			
Medien – 5,38 % (28. Februar 2023: 10,44 %)					
180 Comcast Corp	7.725	3,72			
47 Liberty Media Corp-Liberty Formula One	3.437	1,66			
	11.162	5,38			
Bergbau – 1,94 % (28. Februar 2023: 1,49 %)					
106 Freeport-McMoRan Inc	4.019	1,94			
Pharma – 2,15 % (28. Februar 2023: 2,14 %)					
25 AbbVie Inc	4.466	2,15			
Einzelhandel – 3,57 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
26 Starbucks Corp	2.419	1,17			
45 TJX Cos Inc/The	4.499	2,17			
2 Tractor Supply Co	483	0,23			
	7.401	3,57			
Halbleiter – 9,12 % (28. Februar 2023: 11,40 %)					
12 Broadcom Inc	16.142	7,79			
106 Wolfspeed Inc	2.764	1,33			
	18.906	9,12			

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
5. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	99	Verkauf	USD	65	\$	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	49	Verkauf	AUD	75		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	65	Verkauf	AUD	100		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	EUR	3		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	GBP	6		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SEK	11		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SEK	7		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	212	Verkauf	SGD	284		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	SGD	2		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	-	Verkauf	USD	-		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	44	Verkauf	USD	48		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	51	Verkauf	USD	33		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CHF	53	Verkauf	USD	61		-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CNH	5.938	Verkauf	USD	827		-2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	832	Verkauf	USD	895		5
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	189	Verkauf	USD	238		1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	USD	8		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SEK	313	Verkauf	USD	30		1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	7.108	Verkauf	USD	5.294		-9
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	5.756	Verkauf	USD	3.753		-10
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SEK	-	Verkauf	USD	-		-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 4 \$)								\$	7
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -229 \$)									-22
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -225 \$)								\$	-15

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 78,82 % (28. Februar 2023: 78,26 %)			Einzelhandel – 0,82 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 1,06 % (28. Februar 2023: 2,40 %)			2 Target Corp 293 0,82		
2 L3Harris Technologies Inc	381	1,06	Halbleiter – 7,56 % (28. Februar 2023: 7,20 %)		
Banken – 2,59 % (28. Februar 2023: 3,73 %)			– ASML Holding NV 344 0,96		
4 JPMorgan Chase & Co	737	2,05	1 Broadcom Inc	1.188	3,30
5 US Bancorp	193	0,54	5 Marvell Technology Inc	382	1,06
	930	2,59	1 NXP Semiconductors NV	200	0,56
Getränke – 1,97 % (28. Februar 2023: 1,83 %)			4 QUALCOMM Inc	603	1,68
12 Coca-Cola Co/The	706	1,97		2.717	7,56
Biotechnologie – 1,30 % (28. Februar 2023: 1,29 %)			Software – 7,48 % (28. Februar 2023: 9,72 %)		
2 Amgen Inc	466	1,30	4 Microsoft Corp	1.508	4,20
Chemie – 0,49 % (28. Februar 2023: 2,33 %)			9 Oracle Corp	1.000	2,78
7 Huntsman Corp	175	0,49	1 Paychex Inc	181	0,50
Computer – 4,12 % (28. Februar 2023: 4,70 %)				2.689	7,48
8 Apple Inc	1.482	4,12	Telekommunikation – 1,31 % (28. Februar 2023: 2,44 %)		
Kosmetik u. Körperpflege – 3,29 % (28. Februar 2023: 1,56 %)			3 T-Mobile US Inc	472	1,31
5 Colgate-Palmolive Co	413	1,15	Transport – 2,86 % (28. Februar 2023: 1,45 %)		
5 Procter & Gamble Co/The	771	2,14	3 Union Pacific Corp	743	2,07
	1.184	3,29	2 United Parcel Service Inc 'B'	286	0,79
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,35 % (28. Februar 2023: 3,69 %)				1.029	2,86
45 Blue Owl Capital Inc 'A'	802	2,23	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 19.313 \$)		
1 CME Group Inc	264	0,74		28.325	78,82
4 Intercontinental Exchange Inc	497	1,38	Vorzugsaktien – 5,31 % (28. Februar 2023: 6,35 %)		
	1.563	4,35	Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 2,92 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Elektrik – 4,59 % (28. Februar 2023: 4,78 %)			16 Apollo Global Management Inc	1.048	2,92
5 DTE Energy Co	543	1,51	Elektrik – 1,72 % (28. Februar 2023: 1,34 %)		
20 PPL Corp	517	1,44	18 NextEra Energy Inc	619	1,72
8 Sempra	590	1,64	Gas – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,38 %)		
	1.650	4,59	3 Spire Inc, Series A	122	0,34
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,39 % (28. Februar 2023: 0,94 %)			Medien – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,69 %)		
5 Emerson Electric Co	501	1,39	8 Paramount Global, Series A	119	0,33
Elektronik – 0,56 % (28. Februar 2023: 0,50 %)			Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 2.360 \$)		
2 Amphenol Corp 'A'	202	0,56		1.908	5,31
Energie – Alternative Quellen – 1,41 % (28. Februar 2023: 0,97 %)			Real Estate Investment Trusts – 15,65 % (28. Februar 2023: 8,91 %)		
18 NextEra Energy Partners LP	507	1,41	REITS – 15,65 % (28. Februar 2023: 8,91 %)		
Nahrungsmittel – 1,50 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			22 AGNC Investment Corp	210	0,58
8 McCormick & Co Inc/MD	539	1,50	17 American Homes 4 Rent 'A'	642	1,79
Gesundheit – Produkte – 0,86 % (28. Februar 2023: 1,60 %)			3 American Tower Corp	601	1,67
3 Abbott Laboratories	308	0,86	15 Apartment Income REIT Corp	470	1,31
Versicherungen – 0,44 % (28. Februar 2023: 0,88 %)			4 Boston Properties Inc	269	0,75
1 Chubb Ltd	157	0,44	4 Digital Realty Trust Inc	611	1,70
Internet – 0,79 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			1 Equinix Inc	581	1,62
1 Meta Platforms Inc 'A'	284	0,79	8 Equity LifeStyle Properties Inc	564	1,57
Investmentgesellschaften – 1,58 % (28. Februar 2023: 1,97 %)			4 Extra Space Storage Inc	527	1,46
23 Ares Capital Corp	467	1,30	8 Gaming and Leisure Properties Inc	383	1,07
7 Trinity Capital Inc	101	0,28	9 Global Medical REIT Inc	80	0,22
	568	1,58	5 Prologis Inc	686	1,91
Maschinen – Diversifiziert – 1,37 % (28. Februar 2023: 1,89 %)				5.624	15,65
5 Otis Worldwide Corp	492	1,37	Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 5.282 \$)		
Öl u. Gas – 0,84 % (28. Februar 2023: 0,48 %)				5.624	15,65
1 Pioneer Natural Resources Co	300	0,84	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 26.955 \$)		
Pharma – 8,17 % (28. Februar 2023: 6,46 %)			Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
3 AbbVie Inc	596	1,66	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 3 0,01		
– Eli Lilly & Co	324	0,90	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
3 Johnson & Johnson	549	1,53		35.860	99,79
10 Merck & Co Inc	1.251	3,48	Devisenterminkontrakte – -0,01 % (28. Februar 2023: 0,14 %)		
8 Pfizer Inc	216	0,60	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -3 -0,01		
	2.936	8,17	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Pipelines – 11,77 % (28. Februar 2023: 12,16 %)				-3	-0,01
15 Enbridge Inc	522	1,45	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
36 Kinder Morgan Inc	624	1,73		35.857	99,78
10 ONEOK Inc	780	2,17	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
60 Plains GP Holdings LP, MLP 'A' #	1.037	2,89		79	0,22
35 Williams Cos Inc/The	1.267	3,53	Gesamtnettovermögen		
	4.230	11,77		35.936 \$	100,00
Private Equity – 4,35 % (28. Februar 2023: 1,83 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
12 Blackstone Inc	1.564	4,35	# Master Limited Partnership.		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,23
Finanzderivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	0,76
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)			
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SGD	2	\$	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	SGD	9		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	306	Verkauf	USD	228		-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	520	Verkauf	USD	559		3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CNH	448	Verkauf	USD	62		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.133	Verkauf	USD	739		-2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CNH	15	Verkauf	USD	2		-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1 \$)								\$	3
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -56 \$)									-3
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -55 \$)								\$	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 96,71 % (28. Februar 2023: 96,28 %)			Medien – 1,74 % (28. Februar 2023: 1,56 %)		
Bekleidung – 1,44 % (28. Februar 2023: 1,61 %)			213 Walt Disney Co/The 23.730 1,74		
189 NIKE Inc	19.626	1,44	Verpackung u. Behälter – 1,60 % (28. Februar 2023: 1,50 %)		
Autoteile u. Ausstattung – 0,66 % (28. Februar 2023: 1,25 %)			340 Ball Corp 21.783 1,60		
113 Aptiv Plc	8.987	0,66	Pharma – 5,60 % (28. Februar 2023: 5,46 %)		
Banken – 5,73 % (28. Februar 2023: 6,59 %)			350 CVS Health Corp 25.981 1,90		
288 JPMorgan Chase & Co	53.536	3,92	142 Johnson & Johnson	22.916	1,68
288 Morgan Stanley	24.770	1,81	230 Novo Nordisk A.S ADR	27.541	2,02
Biotechnologie – 2,35 % (28. Februar 2023: 3,47 %)			76.438 5,60		
136 BioMarin Pharmaceutical Inc	11.727	0,86	Einzelhandel – 7,62 % (28. Februar 2023: 5,83 %)		
283 Gilead Sciences Inc	20.396	1,49	58 Costco Wholesale Corp	42.743	3,13
Baumaterialien – 4,17 % (28. Februar 2023: 3,27 %)			91 Home Depot Inc/The	34.413	2,52
111 Trane Technologies Plc	31.229	2,29	114 Williams-Sonoma Inc	26.851	1,97
281 Trex Co Inc	25.754	1,88	104.007 7,62		
Chemie – 1,89 % (28. Februar 2023: 1,43 %)			Halbleiter – 5,97 % (28. Februar 2023: 3,66 %)		
115 Ecolab Inc	25.842	1,89	23 ASML Holding NV	21.682	1,59
Computer – 7,40 % (28. Februar 2023: 6,53 %)			18 Broadcom Inc	23.523	1,72
68 Accenture Plc 'A'	25.296	1,85	27 Lam Research Corp	25.529	1,87
361 Apple Inc	65.157	4,77	150 Marvell Technology Inc	10.740	0,79
113 Dell Technologies Inc	10.663	0,78	81.474 5,97		
Kosmetik u. Körperpflege – 3,51 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Software – 12,28 % (28. Februar 2023: 8,95 %)		
289 Colgate-Palmolive Co	24.994	1,83	280 Microsoft Corp	115.659	8,47
144 Procter & Gamble Co/The	22.906	1,68	94 Salesforce Inc	28.987	2,12
Distribution u. Großhandel – 0,99 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			40 Synopsys Inc	23.053	1,69
260 LKQ Corp	13.571	0,99	167.699 12,28		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 3,74 % (28. Februar 2023: 5,42 %)			Telekommunikation – 1,36 % (28. Februar 2023: 1,86 %)		
27 BlackRock Inc	21.786	1,59	385 Cisco Systems Inc	18.600	1,36
104 Visa Inc 'A'	29.297	2,15	Wasser – 1,44 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Elektrik – 0,74 % (28. Februar 2023: 1,29 %)			166 American Water Works Co Inc 19.662 1,44		
156 Ormat Technologies Inc	10.139	0,74	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.137.550 \$)		
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 3,54 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			1.320.591 96,71		
167 Eaton Corp Plc	48.352	3,54	Real Estate Investment Trusts – 3,45 % (28. Februar 2023: 3,05 %)		
Energie – Alternative Quellen – 1,55 % (28. Februar 2023: 4,53 %)			REITs – 3,45 % (28. Februar 2023: 3,05 %)		
55 Enphase Energy Inc	6.983	0,51	26 Equinix Inc	22.733	1,66
616 Shoals Technologies Group Inc 'A'	7.907	0,58	183 Prologis Inc	24.392	1,79
93 SolarEdge Technologies Inc	6.257	0,46	47.125 3,45		
Umweltkontrolle – 1,58 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 39.487 \$)		
250 Verato Corp	21.573	1,58	47.125 3,45		
Nahrungsmittel – 0,98 % (28. Februar 2023: 1,68 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.177.037 \$)		
195 McCormick & Co Inc/MD	13.393	0,98	1.367.716 100,16		
Hand-/Maschinenwerkzeuge – 1,95 % (28. Februar 2023: 2,35 %)			Devisenterminkontrakte – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
155 Regal Rexnord Corp	26.574	1,95	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 370 0,03		
Gesundheit – Produkte – 5,00 % (28. Februar 2023: 5,15 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
190 Cooper Cos Inc/The	17.797	1,30	1.368.086 100,19		
120 Danaher Corp	30.392	2,23	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: -0,05 %)		
273 Hologic Inc	20.136	1,47	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -16 -		
Gesundheit – Dienstleistungen – 2,12 % (28. Februar 2023: 2,71 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
59 UnitedHealth Group Inc	28.985	2,12	-16 -		
Versicherungen – 3,86 % (28. Februar 2023: 4,57 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
294 Hartford Financial Services Group Inc/The	28.092	2,06	1.368.070 100,19		
112 Travelers Cos Inc/The	24.645	1,80	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
Internet – 5,23 % (28. Februar 2023: 5,25 %)			-2.560 -0,19		
328 Alphabet Inc 'A'	45.369	3,32	Gesamtneuvermögen		
8 Booking Holdings Inc	25.986	1,91	1.365.510 \$ 100,00		
Maschinen – Diversifiziert – 0,67 % (28. Februar 2023: 2,19 %)			-		
25 Deere & Co	9081	0,67	-		

- Beträge, die mit „-“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,44
Finanzderivate	0,03
Sonstige Vermögenswerte	1,53
Gesamtvermögen	100,00

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung		Verkauf Währung		Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten			
		(in Tsd.)	(in Tsd.)	(in Tsd.)	(in Tsd.)	(in Tsd.)	(in Tsd.)		
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	377	Verkauf	EUR	347	\$	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	533	Verkauf	EUR	500		-3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	1.603	Verkauf	GBP	1.275		-6
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	1.203	Verkauf	GBP	951		2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.763	Verkauf	USD	2.229		-7
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	96	Verkauf	USD	103		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	28.543	Verkauf	USD	30.716		153
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	49.346	Verkauf	USD	62.082		215
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 22 \$)								\$	370
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -840 \$)									-16
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -818 \$)								\$	354

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Stammaktien – 99,19 % (28. Februar 2023: 97,30 %)						
Australien – 1,03 % (28. Februar 2023: 1,09 %)						
AUD	18	Brambles Ltd	172	1,03		
Brasilien – 1,41 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
– MercadoLibre Inc						
			236	1,41		
Kanada – 3,60 % (28. Februar 2023: 3,76 %)						
CAD	– Constellation Software Inc/Canada				220	1,31
CAD	2 Loblaw Cos Ltd				212	1,27
CAD	2 Shopify Inc 'A'				169	1,02
			601	3,60		
China – 0,36 % (28. Februar 2023: 3,72 %)						
3 Zai Lab Ltd ADR						
			60	0,36		
Dänemark – 1,95 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
DKK	2 Novo Nordisk A/S				281	1,68
DKK	– Zealand Pharma A/S				45	0,27
			326	1,95		
Frankreich – 2,03 % (28. Februar 2023: 3,20 %)						
EUR	1 Edenred SE				59	0,35
EUR	– LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE				280	1,68
			339	2,03		
Deutschland – 3,08 % (28. Februar 2023: 4,64 %)						
EUR	10 Deutsche Telekom AG				231	1,38
EUR	2 SAP SE				284	1,70
			515	3,08		
Hongkong – 0,61 % (28. Februar 2023: 2,63 %)						
HKD	13 AIA Group Ltd				103	0,61
Indien – 1,08 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
3 HDFC Bank Ltd ADR						
			180	1,08		
Israel – 1,02 % (28. Februar 2023: 0,93 %)						
1 Nice Ltd ADR						
			170	1,02		
Italien – 0,86 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
EUR	– Ferrari NV				143	0,86
Japan – 5,19 % (28. Februar 2023: 5,48 %)						
JPY	1 Daiichi Sankyo Co Ltd				35	0,21
JPY	1 Hoya Corp				169	1,01
JPY	– Keyence Corp				136	0,81
JPY	11 Olympus Corp				161	0,96
JPY	– SMC Corp				176	1,05
JPY	2 Sony Group Corp				192	1,15
			869	5,19		
Mexiko – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
MXN	21 Grupo Bimbo SAB de CV				87	0,52
Niederlande – 3,14 % (28. Februar 2023: 1,61 %)						
– Argenx SE ADR						
EUR	– ASML Holding NV				349	2,09
			525	3,14		
Spanien – 0,72 % (28. Februar 2023: 0,78 %)						
EUR	3 Industria de Diseño Textil SA				120	0,72
Schweden – 0,59 % (28. Februar 2023: 1,02 %)						
SEK	8 Hexagon AB				99	0,59
Schweiz – 1,02 % (28. Februar 2023: 1,84 %)						
CHF	2 Alcon Inc				171	1,02
Taiwan – 2,09 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
TWD	16 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd				350	2,09
Vereinigtes Königreich – 1,96 % (28. Februar 2023: 4,29 %)						
GBP	1 London Stock Exchange Group Plc				159	0,95
GBP	4 RELX Plc				169	1,01
			328	1,96		
USA – 66,93 % (28. Februar 2023: 59,75 %)						
1 AbbVie Inc						
			125	0,75		
1 Accenture Plc 'A'						
			291	1,74		
– Adobe Inc						
			241	1,44		
3 Alphabet Inc 'A'						
			454	2,72		
3 Amazon.com Inc						
			578	3,46		
1 Amphenol Corp 'A'						
			130	0,78		
4 Apple Inc						
			645	3,86		
1 Chubb Ltd						
			137	0,82		
22 Coty Inc						
			271	1,62		
				252	1,51	
				144	0,86	
				536	3,20	
				111	0,67	
				232	1,39	
				342	2,04	
				233	1,39	
				76	0,46	
				400	2,39	
				102	0,61	
				428	2,56	
				813	4,86	
				84	0,50	
				64	0,38	
				45	0,27	
				127	0,76	
				375	2,25	
				139	0,83	
				463	2,77	
				49	0,29	
				113	0,68	
				244	1,46	
				327	1,96	
				121	0,72	
				167	1,00	
				308	1,84	
				160	0,96	
				176	1,05	
				134	0,80	
				251	1,50	
				362	2,16	
				155	0,93	
				185	1,11	
				276	1,65	
				210	1,26	
				113	0,67	
				11.189	66,93	
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 13.259 \$)				16.583	99,19	
Optionsscheine – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
Kanada – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)						
CAD	– Constellation Software Inc/Canada				–	–
Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten – \$)				–	–	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				16.583	99,19	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				16.583	99,19	
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte				135	0,81	
Gesamtnettovermögen				16.718 \$	100,00	
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.						
ABKÜRZUNGEN:						
ADR	– American Depositary Receipt					
AUD	– Australischer Dollar					
CAD	– Kanadischer Dollar					
CHF	– Schweizer Franken					
DKK	– Dänische Krone					
EUR	– Euro					
GBP	– Britisches Pfund Sterling					
HKD	– Hongkong-Dollar					
JPY	– Japanischer Yen					
MXN	– Mexikanischer Peso					
SEK	– Schwedische Kronen					
TWD	– Taiwanesischer Dollar					
Verteilung des Gesamtvermögens				% des Gesamtvermögens		
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				98,29		
Sonstige Vermögenswerte				1,71		
Gesamtvermögen				100,00		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 91,66 % (28. Februar 2023: 93,42 %)		
Australien – 2,05 % (28. Februar 2023: 5,07 %)		
AUD 2.070 Transurban Group	16.869	2,05
Brasilien – 4,77 % (28. Februar 2023: 1,70 %)		
BRL 2.759 Centrais Elétricas Brasileiras SA	22.354	2,72
BRL 3.988 Rumo SA	16.867	2,05
	39.221	4,77
Kanada – 4,89 % (28. Februar 2023: 8,77 %)		
CAD 1.189 Gibson Energy Inc	18.190	2,21
CAD 685 Pembina Pipeline Corp	22.081	2,68
	40.271	4,89
Dänemark – 2,55 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
DKK 406 Orsted AS, 144A	21.005	2,55
Frankreich – 7,05 % (28. Februar 2023: 6,89 %)		
182 Aeroports de Paris SA	23.003	2,80
2214 Getlink SE	34.993	4,25
	57.996	7,05
Deutschland – 4,88 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
1436 E.ON SE	17.024	2,07
449 Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	23.147	2,81
	40.171	4,88
Italien – 5,29 % (28. Februar 2023: 3,23 %)		
4002 Enel SpA	23.561	2,86
2748 Terna – Rete Elettrica Nazionale	19.941	2,43
	43.502	5,29
Japan – 4,04 % (28. Februar 2023: 6,02 %)		
JPY 727 Central Japan Railway Co	16.912	2,06
JPY 299 East Japan Railway Co	16.335	1,98
	33.247	4,04
Portugal – 3,37 % (28. Februar 2023: 3,39 %)		
7522 EDP – Energias de Portugal SA	27.722	3,37
Spanien – 1,84 % (28. Februar 2023: 11,53 %)		
1029 Redeia Corp SA	15.147	1,84
Vereinigtes Königreich – 8,41 % (28. Februar 2023: 10,87 %)		
GBP 1.438 Severn Trent Plc	41.974	5,10
GBP 2.273 United Utilities Group Plc	27.228	3,31
	69.202	8,41
USA – 42,52 % (28. Februar 2023: 35,95 %)		
USD 621 CenterPoint Energy Inc	15.805	1,92
USD 101 Cheniere Energy Inc	14.498	1,76
USD 134 Constellation Energy Corp	20.915	2,54
USD 1.313 CSX Corp	46.056	5,60
USD 685 Dominion Energy Inc	30.313	3,68
USD 335 Entergy Corp	31.486	3,83
USD 852 Ferrovia SE	29.580	3,59
USD 592 NextEra Energy Inc	30.218	3,67
USD 110 Norfolk Southern Corp	25.783	3,13
USD 559 OGE Energy Corp	17.001	2,07
USD 2.544 PG&E Corp	39.257	4,77
USD 307 Public Service Enterprise Group Inc	17.704	2,15
USD 134 Union Pacific Corp	31.323	3,81
	349.939	42,52
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 747.623 €)		
	754.292	91,66
Real Estate Investment Trusts – 6,52 % (28. Februar 2023: 3,73 %)		
USA – 6,52 % (28. Februar 2023: 3,73 %)		
USD 186 American Tower Corp	34.178	4,16
USD 191 Crown Castle Inc	19.447	2,36
	53.625	6,52
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 62.757 €)		
	53.625	6,52
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 810.380 €)		
	807.917	98,18
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,18 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	26	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	807.943	98,18
Devisenterminkontrakte – -0,11 % (28. Februar 2023: -0,10 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-891	-0,11
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-891	-0,11
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	807.052	98,07
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	15.871	1,93
Gesamtnettovermögen		
	822.923 €	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 21.005.000 EUR und machten 2,55 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
CAD	– Kanadischer Dollar
DKK	– Dänische Krone
GBP	– Britisches Pfund Sterling
JPY	– Japanischer Yen
USD	– US-Dollar

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,51
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	2,49
Gesamtvermögen	100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung aus Kontrakten (in Tsd.)
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.212	Verkauf	BRL	6.544	€ -4
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	47	Verkauf	BRL	250	-
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf	BRL	6.794	Verkauf	EUR	1.275	-11
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	24	Verkauf	AUD	39	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	370	Verkauf	CNH	2.891	-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	514	Verkauf	CNH	3.990	1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CNH	145	Verkauf	EUR	19	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CNH	210.181	Verkauf	EUR	27.202	-205
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	6.719	Verkauf	EUR	4.651	-31
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	EUR	1	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	83.258	Verkauf	EUR	77.381	-396
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	300	Verkauf	EUR	277	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	4.030	Verkauf	EUR	2.439	-19
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	5	Verkauf	SGD	7	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	4	Verkauf	SGD	5	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.150	Verkauf	USD	2.331	-3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.516	Verkauf	USD	1.635	6
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	78	Verkauf	AUD	150	1
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CAD	1.248	Verkauf	AUD	1.409	3
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	261	Verkauf	AUD	431	2
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	183	Verkauf	BRL	1.161	-2
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	614	Verkauf	BRL	3.326	-4
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.935	Verkauf	BRL	10.887	-19
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	DKK	312	Verkauf	CAD	62	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	184	Verkauf	CAD	315	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	996	Verkauf	CAD	1.458	5
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CAD	1.573	Verkauf	DKK	8.015	-4
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	329	Verkauf	DKK	2.450	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	98	Verkauf	DKK	855	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	JPY	874	Verkauf	EUR	5	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.115	Verkauf	EUR	1.305	-4
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	BRL	25	Verkauf	EUR	5	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	63	Verkauf	EUR	58	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	DKK	84	Verkauf	EUR	11	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	DKK	24	Verkauf	EUR	3	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CAD	17.797	Verkauf	EUR	12.173	-48
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	2	Verkauf	EUR	1	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.139	Verkauf	GBP	973	4
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	DKK	34	Verkauf	GBP	4	-
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CAD	5.260	Verkauf	GBP	3.073	-2
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	524	Verkauf	JPY	85.151	-4
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	156	Verkauf	JPY	29.711	-2
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.508	Verkauf	JPY	278.584	-16
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CAD	27.734	Verkauf	USD	20.552	-100
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.728	Verkauf	USD	2.191	-9
27. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	5.798	Verkauf	USD	6.280	-7
2. April 2024	BNY Mellon	Kauf	BRL	6.326	Verkauf	EUR	1.167	4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1.921 €)								€ 26
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.058 €)								-891
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 863 €)								€ -865

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 87,73 % (28. Februar 2023: 90,92 %)			Devisenterminkontrakte – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,01 %)		
Australien – 4,36 % (28. Februar 2023: 9,91 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 255 0,08		
AUD 2.143 Atlas Arteria Ltd	7.523	2,27	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 326.490 98,40		
AUD 788 Transurban Group	6.942	2,09	Devisenterminkontrakte – -0,04 % (28. Februar 2023: 0,55 %)		
	14.465	4,36	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -124 -0,04		
Brasilien – 2,81 % (28. Februar 2023: 3,91 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten -124 -0,04		
BRL 1.810 CCR SA	5.016	1,51	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 326.366 98,36		
BRL 606 CPFL Energia SA	4.314	1,30	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte 5.443 1,64		
	9.330	2,81	Gesamnettovermögen 331.809 \$ 100,00		
Kanada – 6,85 % (28. Februar 2023: 10,67 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
CAD 90 Enbridge Inc	3.111	0,94	ABKÜRZUNGEN:		
CAD 342 Gibson Energy Inc	5.646	1,70	AUD – Australischer Dollar		
CAD 304 Pembina Pipeline Corp	10.577	3,19	BRL – Brasilianischer Real		
CAD 86 TC Energy Corp	3.387	1,02	CAD – Kanadischer Dollar		
	22.721	6,85	EUR – Euro		
China – 1,71 % (28. Februar 2023: 1,17 %)			GBP – Britisches Pfund Sterling		
HKD 1.879 China Resources Gas Group Ltd	5.665	1,71	HKD – Hongkong-Dollar		
Frankreich – 2,18 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			JPY – Japanischer Yen		
EUR 53 Aeroports de Paris SA	7.239	2,18			
Deutschland – 1,50 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
EUR 388 E.ON SE	4.970	1,50			
Italien – 6,44 % (28. Februar 2023: 4,87 %)					
EUR 1.625 Enel SpA	10.343	3,12			
EUR 2.358 Snam SpA	11.015	3,32			
	21.358	6,44			
Japan – 3,49 % (28. Februar 2023: 3,51 %)					
JPY 279 West Japan Railway Co	11.597	3,49			
Portugal – 4,37 % (28. Februar 2023: 5,27 %)					
EUR 3.641 EDP – Energias de Portugal SA	14.501	4,37			
Spanien – 5,85 % (28. Februar 2023: 11,64 %)					
EUR 271 Enagas SA	3.924	1,18			
EUR 552 Iberdrola SA	6.334	1,91			
EUR 576 Redeia Corp SA	9.165	2,76			
	19.423	5,85			
Vereinigtes Königreich – 10,11 % (28. Februar 2023: 14,11 %)					
GBP 1.146 National Grid Plc	14.999	4,52			
GBP 931 Pennon Group Plc	7.776	2,34			
GBP 228 Severn Trent Plc	7.187	2,17			
GBP 277 United Utilities Group Plc	3.582	1,08			
	33.544	10,11			
USA – 38,06 % (28. Februar 2023: 25,86 %)					
131 Brookfield Renewable Corporation	3.113	0,94			
38 Constellation Energy Corp	6.320	1,90			
290 Dominion Energy Inc	13.885	4,18			
165 Entergy Corp	16.726	5,04			
209 Eversource Energy	12.252	3,69			
228 Ferrovia SE	8.567	2,58			
191 NextEra Energy Inc	10.505	3,17			
315 NextEra Energy Partners LP	8.643	2,60			
339 OGE Energy Corp	11.136	3,36			
115 Public Service Enterprise Group Inc	7.156	2,16			
194 Southern Co/The	13.033	3,93			
59 Union Pacific Corp	14.957	4,51			
	126.293	38,06			
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 305.721 \$)					
Vorzugsaktien – 2,48 % (28. Februar 2023: 1,42 %)					
Brasilien – 2,48 % (28. Februar 2023: 1,42 %)					
BRL 854 Centrais Eletricas Brasileiras SA	8.231	2,48			
Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 6.781 \$)					
Real Estate Investment Trusts – 8,11 % (28. Februar 2023: 6,00 %)					
USA – 8,11 % (28. Februar 2023: 6,00 %)					
63 American Tower Corp	12.523	3,78			
131 Crown Castle Inc	14.375	4,33			
	26.898	8,11			
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 30.813 \$)					
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 343.315 \$)					
	326.235	98,32			

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,18
Finanzderivate	0,08
Sonstige Vermögenswerte	3,74
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung		Verkauf Währung		Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)			
		(in Tsd.)		(in Tsd.)					
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	220	Verkauf	AUD	340	\$	-2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	159	Verkauf	CNH	1.148		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	1.622	Verkauf	EUR	1.513		-16
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	7.837	Verkauf	EUR	7.236		11
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	270	Verkauf	GBP	213		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	138	Verkauf	GBP	109		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	2.505	Verkauf	SGD	3.380		-7
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	510	Verkauf	SGD	685		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	23	Verkauf	USD	18		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SGD	70.853	Verkauf	USD	52.772		-78
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	GBP	4.544	Verkauf	USD	5.715		20
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	968	Verkauf	USD	1.048		-1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	40.702	Verkauf	USD	43.795		224
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	CNH	11.711	Verkauf	USD	1.630		-4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	1	Verkauf	USD	1		-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	AUD	8.999	Verkauf	USD	5.869		-16
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 24 \$)							\$	255	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.229 \$)								-124	
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.205 \$)							\$	131	

FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 91,18 %					
Frankreich – 11,94 %					
EUR	3	BNP Paribas SA	151	2,68	
EUR	2	Nexans SA	162	2,86	
EUR	4	TotalEnergies SE	237	4,20	
EUR	4	Veolia Environnement SA	124	2,20	
			674	11,94	
Deutschland – 4,87 %					
EUR	1	Gerresheimer AG	102	1,82	
EUR	1	Siemens AG	172	3,05	
			274	4,87	
Hongkong – 1,80 %					
HKD	13	AIA Group Ltd	102	1,80	
Indonesien – 1,95 %					
IDR	282	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	110	1,95	
Japan – 5,26 %					
JPY	4	Hitachi Ltd	297	5,26	
Spanien – 3,88 %					
EUR	22	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	219	3,88	
Vereinigtes Königreich – 12,29 %					
GBP	1	AstraZeneca Plc	177	3,14	
GBP	9	Compass Group Plc	235	4,16	
GBP	4	Unilever Plc	177	3,15	
GBP	8	United Utilities Group Plc	104	1,84	
			693	12,29	
USA – 49,19 %					
	7	AES Corp/The	103	1,82	
	3	American International Group Inc	182	3,23	
	–	Biogen Inc	54	0,96	
CAD	3	Brookfield Renewable Corp	61	1,09	
	2	Charles Schwab Corp/The	108	1,91	
	2	Chesapeake Energy Corp	156	2,76	
	5	CNH Industrial NV	58	1,03	
	11	Coty Inc	137	2,43	
	1	Fiserv Inc	204	3,61	
	3	Freeport-McMoRan Inc	129	2,28	
	1	Johnson & Johnson	174	3,09	
	–	Meta Platforms Inc 'A'	239	4,24	
	2	NextEra Energy Inc	96	1,69	
	2	Oracle Corp	178	3,16	
EUR	1	Schneider Electric SE	164	2,91	
	2	Uber Technologies Inc	173	3,06	
	–	UnitedHealth Group Inc	118	2,10	
	3	Vertiv Holdings Co 'A'	224	3,97	
	4	Wells Fargo & Co	217	3,85	
			2.775	49,19	
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 4.468 \$)			5.144 91,18		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 4.468 \$)			5.144 91,18		
Devisenterminkontrakte – 0,00 %					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			– –		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			5.144 91,18		
Devisenterminkontrakte – 0,00 %					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			– –		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			– –		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			5.144 91,18		
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			497 8,82		
Gesamtnettovermögen			5.641 \$ 100,00		
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
ABKÜRZUNGEN:					
CAD – Kanadischer Dollar					
EUR – Euro					
GBP – Britisches Pfund Sterling					
HKD – Hongkong-Dollar					
IDR – Indonesische Rupiah					
JPY – Japanischer Yen					
					% des
Verteilung des Gesamtvermögens					Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					90,74
Sonstige Vermögenswerte					9,26
Gesamtvermögen					100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD	16 Verkauf USD	11 \$ –	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	9 Verkauf USD	11 –	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	10 Verkauf USD	11 –	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	– Verkauf USD	1 –	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	– Verkauf USD	– –	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten					–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten					–
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten					–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,52 % (28. Februar 2023: 4,39 %)			Computer – 3,32 % (28. Februar 2023: 1,39 %)				
17.542	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	17.542	2,52	739	Conduent Inc	2.538	0,36
				37	Endava Plc ADR	1.373	0,20
				174	Grid Dynamics Holdings Inc	2.342	0,34
				252	Kyndryl Holdings Inc	5.538	0,80
				408	SecureWorks Corp	2.716	0,39
				128	TaskUS Inc 'A'	1.698	0,24
				163	TTEC Holdings Inc	2.846	0,41
				70	WNS Holdings Ltd ADR	4.029	0,58
						23.080	3,32
			Kosmetik u. Körperpflege – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,30 %)				
				16	Inter Parfums Inc	2.393	0,34
			Distribution u. Großhandel – 3,49 % (28. Februar 2023: 3,30 %)				
				293	Hudson Technologies Inc	4.297	0,62
				480	Manitex International Inc	3.271	0,47
				334	MRC Global Inc	3.845	0,55
				144	Resideo Technologies Inc	3.213	0,46
				73	VSE Corp	5.383	0,78
				29	WESCO International Inc	4.254	0,61
						24.263	3,49
			Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 2,70 % (28. Februar 2023: 2,13 %)				
				101	Air Lease Corp 'A'	4.060	0,58
				67	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	2.904	0,42
			CAD	550	Canaccord Genuity Group Inc	3.257	0,47
				280	GCM Grosvenor Inc	2.369	0,34
				51	Moelis & Co 'A'	2.779	0,40
				247	Perella Weinberg Partners 'A'	3.374	0,49
						18.743	2,70
			Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,51 % (28. Februar 2023: 1,16 %)				
				223	American Superconductor Corp	3.006	0,43
				91	Insteel Industries Inc	3.313	0,48
				314	nLight Inc	4.152	0,60
						10.471	1,51
			Elektronik – 5,42 % (28. Februar 2023: 5,34 %)				
				34	Advanced Energy Industries Inc	3.450	0,50
				219	Applied Optoelectronics Inc	3.500	0,50
				168	Benchmark Electronics Inc	5.146	0,74
				65	Coherent Corp	3.855	0,56
				245	Comtech Telecommunications Corp	1.661	0,24
				92	CTS Corp	4.110	0,59
				100	FARO Technologies Inc	2.248	0,32
				413	Identiv Inc	3.560	0,51
				268	Knowles Corp	4.378	0,63
				260	Stoneridge Inc	4.559	0,66
				55	Vishay Intertechnology Inc	1.188	0,17
						37.655	5,42
			Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 3,82 % (28. Februar 2023: 3,93 %)				
				17	Arcosa Inc	1.433	0,21
				408	Concrete Pumping Holdings Inc	3.343	0,48
				65	Construction Partners Inc 'A'	3.128	0,45
				78	Limbach Holdings Inc	3.866	0,56
				502	Mistras Group Inc	4.338	0,62
				578	Orion Group Holdings Inc	3.441	0,49
				128	Primoris Services Corp	5.040	0,72
				19	Sterling Infrastructure Inc	1.985	0,29
						26.574	3,82
			Unterhaltung – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,32 %)				
				136	IMAX Corp	2.334	0,34
			Umweltkontrolle – 0,77 % (28. Februar 2023: 0,55 %)				
				237	CECO Environmental Corp	5.355	0,77
			Nahrungsmittel – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,51 %)				
				120	Krispy Kreme Inc	1.559	0,22
				443	SunOpta Inc	3.117	0,45
						4.676	0,67
			Hand-/Maschinenwerkzeuge – 0,46 % (28. Februar 2023: 0,80 %)				
				36	Hurco Cos Inc	930	0,13
				228	Luxfer Holdings Plc	2.257	0,33
						3.187	0,46
			Gesundheit – Produkte – 3,11 % (28. Februar 2023: 2,02 %)				
				1120	Accuray Inc	2.919	0,42
				59	AngioDynamics Inc	322	0,05
				522	Apyx Medical Corp	1.102	0,16
				268	Artivion Inc	5.175	0,74
				49	Azenta Inc	3.218	0,46
				304	MiMedx Group Inc	2.480	0,36
				179	Tactile Systems Technology Inc	2.729	0,39
						41.408	5,96

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – (Fortsetzung)			Fertigung diverse – 1,11 % (28. Februar 2023: 1,63 %)		
Gesundheit – Produkte – (Fortsetzung)			19 Enpro Inc	3.024	0,43
212 Vares Imaging Corp	3.646	0,53	9 Fabrinet	1.934	0,28
	21.591	3,11	109 Trinity Industries Inc	2.753	0,40
				7.711	1,11
Gesundheit – Dienstleistungen – 1,42 % (28. Februar 2023: 1,33 %)			Büro- und Geschäftseinrichtung – 0,49 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
456 Community Health Systems Inc	1.275	0,18	183 Xerox Holdings Corp	3.404	0,49
41 ModivCare Inc	1.148	0,16			
417 Quipt Home Medical Corp	1.790	0,26	Öl u. Gas – 2,08 % (28. Februar 2023: 2,57 %)		
90 RadNet Inc	3.399	0,49	807 Baytex Energy Corp	2.586	0,37
84 Select Medical Holdings Corp	2.277	0,33	57 Matador Resources Co	3.605	0,52
	9.889	1,42	103 Northern Oil & Gas Inc	3.666	0,53
Bauunternehmen – 3,18 % (28. Februar 2023: 2,86 %)			227 Patterson-UTI Energy Inc	2.623	0,38
61 Beazer Homes USA Inc	1.899	0,27	281 Southwestern Energy Co	1.959	0,28
10 Cavco Industries Inc	3.866	0,56		14.439	2,08
23 Century Communities Inc	1.970	0,28	Öl- u. Gasdienstleistungen – 3,71 % (28. Februar 2023: 2,41 %)		
14 MI Homes Inc	1.812	0,26	194 Archrock Inc	3.549	0,51
62 Skyline Champion Corp	5.204	0,75	116 DMC Global Inc	1.942	0,28
55 Taylor Morrison Home Corp 'A'	3.082	0,44	217 DNOW Inc	3.059	0,44
19 Toll Brothers Inc	2.227	0,32	432 Mammoth Energy Services Inc	1.580	0,23
59 Tri Pointe Homes Inc	2.070	0,30	273 Matrix Service Co	3.218	0,46
	22.130	3,18	385 Newpark Resources Inc	2.472	0,36
Wohnungseinrichtungen – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,18 %)			171 ProPetro Holding Corp	1.261	0,18
406 VIA Optronics AG ADR	352	0,05	225 Ranger Energy Services Inc	2.356	0,34
Haushaltswaren u. -artikel – 0,47 % (28. Februar 2023: 0,40 %)			375 Select Water Solutions Inc	3.201	0,46
40 Spectrum Brands Holdings Inc	3.250	0,47	369 Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	3.131	0,45
Versicherungen – 0,54 % (28. Februar 2023: 0,33 %)				25.769	3,71
81 Brighthouse Financial Inc	3.769	0,54	Verpackung u. Behältnisse – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,47 %)		
Internet – 5,72 % (28. Februar 2023: 3,78 %)			105 Trimas Corp	2.460	0,35
94 Beyond Inc	3.163	0,46	Pharma – 0,98 % (28. Februar 2023: 0,93 %)		
164 Cars.com Inc	3.005	0,43	179 AdaptHealth Corp 'A'	1.829	0,26
33 comScore Inc	647	0,09	219 Organon & Co	3.813	0,55
117 Criteo SA ADR	3.796	0,55	1092 Societal CDMO Inc	1.162	0,17
821 DHI Group Inc	2.328	0,33		6.804	0,98
698 Entravision Communications Corp	2.683	0,39	Immobilien – 0,09 % (28. Februar 2023: 0,17 %)		
314 EverQuote Inc	5.032	0,72	232 Fathom Holdings Inc	654	0,09
81 IAC Inc	4.597	0,66	Einzelhandel – 5,41 % (28. Februar 2023: 7,40 %)		
925 Innovid Corp	1.733	0,25	33 Advance Auto Parts Inc	2.217	0,32
306 LifeMD Inc	2.433	0,35	17 Asbury Automotive Group Inc	3.528	0,51
415 Magnite Inc	4.981	0,72	92 Caleres Inc	3.546	0,51
366 QuinStreet Inc	5.356	0,77	230 Designer Brands Inc	2.434	0,35
	39.754	5,72	11 Dillard's Inc	4.715	0,68
Eisen/Stahl – 2,30 % (28. Februar 2023: 3,20 %)			121 J Jill Inc	3.028	0,44
106 ATI Inc	5.224	0,75	60 MarineMax Inc	1.995	0,29
73 Carpenter Technology Corp	4.693	0,67	838 Noodles & Co 'A'	2.112	0,30
73 Commercial Metals Co	3.929	0,57	214 Nordstrom Inc	4.480	0,64
36 Haynes International Inc	2.143	0,31	82 OneWater Marine Inc 'A'	2.140	0,31
	15.989	2,30	30 Patrick Industries Inc	3.642	0,52
Unterkünfte – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,61 %)			193 Vera Bradley Inc	1.506	0,22
136 Century Casinos Inc	396	0,06	79 Victoria's Secret & Co	2.242	0,32
Maschinen – Bau u. Bergbau – 1,34 % (28. Februar 2023: 1,43 %)				37.585	5,41
60 Argan Inc	2.790	0,40	Sparen u. Kredite – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,52 %)		
536 Babcock & Wilcox Enterprises Inc	684	0,10	36 Axos Financial Inc	1.898	0,27
39 BWX Technologies Inc	3.893	0,56	Halbleiter – 5,78 % (28. Februar 2023: 5,09 %)		
33 Terex Corp	1.908	0,28	139 Alpha & Omega Semiconductor Ltd	3.033	0,44
	9.275	1,34	84 Amkor Technology Inc	2.601	0,37
Maschinen – Diversifiziert – 1,99 % (28. Februar 2023: 2,02 %)			399 Amtech Systems Inc	1.929	0,28
22 Chart Industries Inc	3.171	0,46	111 Cohu Inc	3.563	0,51
125 Ichor Holdings Ltd	5.332	0,77	112 FormFactor Inc	4.827	0,70
745 Intevac Inc	2.883	0,41	199 inTEST Corp	2.332	0,34
65 Power Solutions International Inc	133	0,02	40 IPG Photonics Corp	3.484	0,50
149 Twin Disc Inc	2.312	0,33	73 Kulicke & Soffa Industries Inc	3.476	0,50
	13.831	1,99	11 Onto Innovation Inc	2.046	0,29
Medien – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,48 %)			122 Ultra Clean Holdings Inc	5.267	0,76
139 Thryv Holdings Inc	2.906	0,42	144 Veeco Instruments Inc	5.208	0,75
Metallherstellung u. -elemente – 2,06 % (28. Februar 2023: 2,27 %)			68 Vishay Precision Group Inc	2.369	0,34
66 Helios Technologies Inc	2.911	0,42		40.135	5,78
223 Mayville Engineering Co Inc	2.701	0,39	Software – 2,01 % (28. Februar 2023: 1,81 %)		
208 Metallus Inc	4.526	0,65	177 ACV Auctions Inc	3.147	0,45
141 Northwest Pipe Co	4.209	0,60	169 Digi International Inc	5.001	0,72
	14.347	2,06	365 Immersion Corp	2.462	0,36
Bergbau – 1,31 % (28. Februar 2023: 1,17 %)			368 Viant Technology Inc	3.356	0,48
CAD 525 Capstone Copper Corp	2.761	0,40		13.966	2,01
671 Ferroglobe Plc	3.048	0,44	Telekommunikation – 2,81 % (28. Februar 2023: 4,15 %)		
CAD 566 Major Drilling Group International Inc	3.281	0,47	244 A10 Networks Inc	3.245	0,47
	9.090	1,31	274 Applied Digital Corp	1.136	0,16
			106 Aviat Networks Inc	3.761	0,54
			83 Clearfield Inc	2.496	0,36

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Stammaktien – (Fortsetzung)			Devisenterminkontrakte – -0,02 % (28. Februar 2023: 0,22 %)			
Telekommunikation – (Fortsetzung)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			
515	DZS Inc	760	0,11	-170	-0,02	
131	Frequency Electronics Inc	1.409	0,20	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
347	Infinera Corp	1.742	0,25	-170	-0,02	
297	Ooma Inc	3.025	0,44	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
657	Ribbon Communications Inc	1.974	0,28	689.264	99,19	
		19.548	2,81	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
				5.626	0,81	
				Gesamtneuvermögen		
				694.890 \$	100,00	
Transport – 2,67 % (28. Februar 2023: 3,64 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.			
262	Ardmore Shipping Corp	4.256	0,61	ABKÜRZUNGEN:		
100	Hub Group Inc 'A'	4.270	0,62	ADR	– American Depositary Receipt	
251	Navigator Holdings Ltd	3.757	0,54	CAD	– Kanadischer Dollar	
383	Radiant Logistics Inc	2.214	0,32	Verteilung des Gesamtvermögens		
60	Scorpio Tankers Inc	4.056	0,58	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
		18.553	2,67	Organismen für gemeinsame Anlagen		
				Finanzderivate		
				Sonstige Vermögenswerte		
				Gesamtvermögen		
				100,00		
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 618.471 \$)			671.600			96,65
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 636.013 \$)			689.142			99,17
Devisenterminkontrakte – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,02 %)			292			0,04
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)						
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			689.434			99,21

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung aus Kontrakten (in Tsd.)
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	5.572 Verkauf BRL	27.702 \$ 2
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf BRL	1.172 Verkauf USD	235 1
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf BRL	26.530 Verkauf USD	5.387 -53
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	236 Verkauf AUD	366 -2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	281 Verkauf AUD	430 1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	208 Verkauf CNH	1.488 –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	138 Verkauf CNH	1.000 –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	1.465 Verkauf EUR	1.365 -10
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	1.166 Verkauf EUR	1.077 2
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	6 Verkauf GBP	5 –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	330 Verkauf PLN	1.337 -5
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	3 Verkauf SEK	30 –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	3 Verkauf SEK	29 –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	460 Verkauf SGD	619 –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	1.985 Verkauf SGD	2.680 -6
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	4.950 Verkauf USD	5.366 -13
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD	100 Verkauf USD	66 –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK	720 Verkauf USD	68 1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	119 Verkauf USD	149 1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf PLN	33.397 Verkauf USD	8.256 106
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD	2.768 Verkauf USD	2.056 1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD	50.453 Verkauf USD	37.575 -54
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD	9.003 Verkauf USD	5.871 -18
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNH	3.352 Verkauf USD	465 –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	32.990 Verkauf USD	35.504 177
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNH	22.573 Verkauf USD	3.144 -8
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SEK	2 Verkauf USD	– –
2. April 2024	BNY Mellon	Kauf BRL	27.320 Verkauf USD	5.478 -1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 150 \$)				\$ 292
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.623 \$)				-170
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.473 \$)				\$ 122

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,75 % (28. Februar 2023: 3,48 %)			Maschinen – Diversifiziert – 3,52 % (28. Februar 2023: 3,50 %)		
13 iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.915	2,00	17 Esab Corp	1.690	1,76
1681 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.681	1,75	5 Kadant Inc	1.684	1,76
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.487 \$)	3.596	3,75		3.374	3,52
Stammaktien – 96,40 % (28. Februar 2023: 97,23 %)			Metallherstellung u. -elemente – 1,76 % (28. Februar 2023: 0,65 %)		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 2,10 % (28. Februar 2023: 1,09 %)			54 Janus International Group Inc	779	0,81
89 Leonardo DRS Inc	2.014	2,10	16 Northwest Pipe Co	488	0,51
Bekleidung – 2,33 % (28. Februar 2023: 2,41 %)			13 Ryerson Holding Corp	422	0,44
12 Carter's Inc	952	0,99		1.689	1,76
30 Steven Madden Ltd	1.283	1,34	Fertigung diverse – 5,16 % (28. Februar 2023: 5,33 %)		
	2.235	2,33	14 Enpro Inc	2.143	2,24
Autoteile u. Ausstattung – 3,33 % (28. Februar 2023: 3,47 %)			4 Fabrinet	776	0,81
48 Gentex Corp	1.750	1,82	20 John Bean Technologies Corp	2.027	2,11
32 Miller Industries Inc/TN	1.445	1,51		4.946	5,16
	3.195	3,33	Öl- u. Gasdienstleistungen – 1,69 % (28. Februar 2023: 1,54 %)		
Biotechnologie – 0,79 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			CAD 159 Pason Systems Inc	1.622	1,69
19 Halozyme Therapeutics Inc	762	0,79	Pharma – 2,36 % (28. Februar 2023: 3,27 %)		
Baumaterialien – 2,04 % (28. Februar 2023: 2,02 %)			141 Catalyst Pharmaceuticals Inc	2.263	2,36
26 Louisiana-Pacific Corp	1.954	2,04	Immobilien – 4,63 % (28. Februar 2023: 3,88 %)		
Chemie – 3,22 % (28. Februar 2023: 3,48 %)			281 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.469	2,57
18 Innospec Inc	2.224	2,32	54 Marcus & Millichap Inc	1.971	2,06
4 Quaker Chemical Corp	868	0,90		4.440	4,63
	3.092	3,22	Einzelhandel – 1,36 % (28. Februar 2023: 1,49 %)		
Gewerbliche Dienstleistungen – 9,74 % (28. Februar 2023: 7,42 %)			45 Movado Group Inc	1.303	1,36
3 AMN Healthcare Services Inc	176	0,18	Halbleiter – 9,55 % (28. Februar 2023: 9,18 %)		
31 Cass Information Systems Inc	1.473	1,54	11 Cirrus Logic Inc	968	1,01
157 Dun & Bradstreet Holdings Inc	1.660	1,73	35 Cohu Inc	1.138	1,19
81 Forrester Research Inc	1.633	1,70	48 FormFactor Inc	2.074	2,16
45 Korn Ferry	2.868	2,99	21 MKS Instruments Inc	2.591	2,70
36 Valvoline Inc	1.534	1,60	3 Onto Innovation Inc	475	0,49
	9.344	9,74	55 Vishay Precision Group Inc	1.917	2,00
Computer – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,00 %)				9.163	9,55
9 Crane NXT Co	502	0,52	Software – 0,63 % (28. Februar 2023: 2,94 %)		
Kosmetik u. Körperpflege – 1,90 % (28. Februar 2023: 2,16 %)			15 Simulations Plus Inc	608	0,63
12 Inter Parfums Inc	1.826	1,90	Transport – 1,56 % (28. Februar 2023: 3,63 %)		
Distribution u. Großhandel – 0,84 % (28. Februar 2023: 2,20 %)			8 Landstar System Inc	1.500	1,56
55 Hudson Technologies Inc	801	0,84	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 82.912 \$)		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 8,07 % (28. Februar 2023: 7,55 %)				92.486	96,40
56 Air Lease Corp 'A'	2.242	2,34	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 86.399 \$)		
41 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.780	1,86		96.082	100,15
17 Houlihan Lokey Inc 'A'	2.133	2,22	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
41 Lazard Inc 'A'	1.587	1,65	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	7.742	8,07		1	–
Elektronik – 6,67 % (28. Februar 2023: 5,96 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
31 Atmus Filtration Technologies Inc	747	0,78		96.083	100,15
31 Brady Corp 'A'	1.811	1,89	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
26 ESCO Technologies Inc	2.601	2,71	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
55 Kimball Electronics Inc	1.241	1,29		–	–
	6.400	6,67	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 3,75 % (28. Februar 2023: 2,22 %)				–	–
33 Arcosa Inc	2.769	2,89	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
10 Exponent Inc	826	0,86		96.083	100,15
	3.595	3,75	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
Gesundheit – Produkte – 6,65 % (28. Februar 2023: 5,87 %)				-148	-0,15
38 Bio-Techne Corp	2.831	2,95	Gesamtneuvermögen		
34 Enovis Corp	2.008	2,09		95.935 \$	100,00
24 Envista Holdings Corp	505	0,53	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
5 UFP Technologies Inc	1.034	1,08	ABKÜRZUNGEN:		
	6.378	6,65	ETF – Börsengehandelter Fonds		
Bauunternehmen – 3,11 % (28. Februar 2023: 3,71 %)			CAD – Kanadischer Dollar		
6 LCI Industries	809	0,85	Verteilung des Gesamtvermögens		
26 Skyline Champion Corp	2.171	2,26	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
	2.980	3,11	Organismen für gemeinsame Anlagen		
Versicherungen – 3,60 % (28. Februar 2023: 4,88 %)			Finanzderivate		
10 RLI Corp	1.417	1,48	Sonstige Vermögenswerte		
1 White Mountains Insurance Group Ltd	2.040	2,12		0,42	
	3.457	3,60	Gesamtvermögen		
Internet – 2,97 % (28. Februar 2023: 2,92 %)				100,00	
41 Ziff Davis Inc	2.850	2,97			
Freizeit – 2,04 % (28. Februar 2023: 1,59 %)					
22 Brunswick Corp.DE	1.959	2,04			
Unterkünfte – 0,51 % (28. Februar 2023: 1,99 %)					
169 Century Casinos Inc	492	0,51			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	EUR	6	\$	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	SEK	29	Verkauf	USD	3		–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR	181	Verkauf	USD	194		1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – USD)								\$	1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2 \$)									–
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2 \$)								\$	1

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,76 % (28. Februar 2023: 4,24 %)					
209 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)					
	209	4,76			
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 209 \$)					
	209	4,76			
Stammaktien – 96,05 % (28. Februar 2023: 96,21 %)					
Australien – 3,53 % (28. Februar 2023: 3,53 %)					
AUD	25	1,81			
AUD	18	1,72			
	155	3,53			
Belgien – 0,91 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
EUR	2	0,91			
Brasilien – 1,68 % (28. Februar 2023: 1,03 %)					
BRL	18	1,01			
BRL	5	0,67			
	74	1,68			
Kanada – 6,22 % (28. Februar 2023: 1,16 %)					
	1	2,16			
	1	2,60			
	1	1,46			
	273	6,22			
Frankreich – 0,81 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
EUR	1	0,81			
Italien – 3,16 % (28. Februar 2023: 3,01 %)					
EUR	1	0,68			
EUR	–	1,00			
EUR	9	1,48			
	139	3,16			
Japan – 11,23 % (28. Februar 2023: 11,67 %)					
JPY	1	0,88			
JPY	4	1,76			
JPY	1	1,21			
JPY	3	1,83			
JPY	2	0,97			
JPY	1	0,98			
JPY	3	1,81			
JPY	2	0,59			
JPY	2	1,20			
	492	11,23			
Jersey – 0,77 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
GBP	3	0,77			
Niederlande – 1,07 % (28. Februar 2023: 2,14 %)					
EUR	–	1,07			
Polen – 1,26 % (28. Februar 2023: 1,33 %)					
PLN	3	1,26			
Südkorea – 1,76 % (28. Februar 2023: 1,99 %)					
KRW	10	1,76			
Schweden – 1,33 % (28. Februar 2023: 1,07 %)					
SEK	9	1,33			
Schweiz – 1,66 % (28. Februar 2023: 1,79 %)					
CHF	–	0,85			
CHF	–	0,81			
	73	1,66			
Vereinigtes Königreich – 13,88 % (28. Februar 2023: 12,45 %)					
GBP	10	1,75			
GBP	1	0,97			
GBP	1	1,20			
GBP	7	1,41			
GBP	1	1,09			
GBP	71	1,68			
GBP	14	2,07			
GBP	27	1,80			
GBP	–	1,14			
GBP	2	0,77			
	609	13,88			
USA – 46,01 % (28. Februar 2023: 52,24 %)					
	1	1,75			
	–	0,75			
	1	1,29			
	1	1,66			
	–	0,57			
	1	1,87			
	58	1,33			
	1	1,28			
	25	0,56			
	1	1,03			
	1	2,02			
	–	1,08			
	1	2,11			
	–	1,17			
	–	1,51			
	1	1,60			
	–	1,96			
	6	1,12			
	–	1,27			
	–	0,52			
	–	2,12			
	1	1,50			
	1	0,69			
	1	2,46			
	–	1,64			
	–	1,55			
	–	1,11			
	1	1,78			
	1	1,55			
	–	1,35			
	2	2,09			
	1	1,72			
	2.018	46,01			
Vietnam – 0,77 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
GBP	3	0,77			
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 4.303 \$)					
	4.213	96,05			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			4.422 100,81		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			4.422 100,81		
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten			-36 -0,81		
Gesamtnettovermögen			4.386 \$ 100,00		
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 129.000 USD und machten 2,93 % des Nettovermögens aus.					
ABKÜRZUNGEN:					
AUD	– Australischer Dollar				
BRL	– Brasilianischer Real				
CHF	– Schweizer Franken				
EUR	– Euro				
GBP	– Britisches Pfund Sterling				
JPY	– Japanischer Yen				
KRW	– Südkoreanischer Won				
PLN	– Polnischer Zloty				
SEK	– Schwedische Kronen				
Verteilung des Gesamtvermögens			% des Gesamtvermögens		
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			94,89		
Organismen für gemeinsame Anlagen			4,71		
Sonstige Vermögenswerte			0,40		
Gesamtvermögen			100,00		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^μ

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)	
Russland – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)	
GBP 54 Evraz Plc †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 313 €)	–
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtnettvermögen	– €

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

† Nicht liquide.

μ Mit Wirkung vom 11. Juli 2022 hat der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^μ den Handel eingestellt.

ABKÜRZUNGEN:

GBP – Britisches Pfund Sterling

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	–
Sonstige Vermögenswerte	100,00
Gesamtvermögen	100,00

^μ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^{^F}

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)	
Hongkong – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)	
HKD 38 Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 44 \$)	–
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtnettvermögen	– \$

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

† Nicht liquide.

F Mit Wirkung vom 14. November 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^] den Handel eingestellt.

ABKÜRZUNGEN:

HKD – Hongkong-Dollar

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	–
Sonstige Vermögenswerte	100,00
Gesamtvermögen	100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)	
Russland – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)	
8 Gazprom PJSC ADR †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 54 \$)	–
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtvermögen	– \$

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

† Nicht liquide.

α Mit Wirkung vom 27. April 2022 hat der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α den Handel eingestellt.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	–
Sonstige Vermögenswerte	100,00
Gesamtvermögen	100,00

^α In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,31 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			17 RestMed Inc		
1620 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)			13 Veeva Systems Inc 'A'		
	1.620	1,31	16 Zoetis Inc		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.620 \$)			63.500		
			122.293		
Stammaktien – 98,60 % (28. Februar 2023: 101,05 %)			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 100.292 \$)		
Dänemark – 2,83 % (28. Februar 2023: 3,50 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 101.912 \$)		
DKK 26 Coloplast A.S			123.913		
	3.512	2,83	Devisenterminkontrakte – 0,31 % (28. Februar 2023: 0,03 %)		
Frankreich – 11,23 % (28. Februar 2023: 10,14 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
EUR 5 Kering SA			385		
	2.203	1,78	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
EUR 10 L'Oreal SA			124.298		
	4.541	3,66	Devisenterminkontrakte – -0,02 % (28. Februar 2023: 1,01 %)		
EUR 15 Pernod Ricard SA			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	2.465	1,99	-22		
EUR 17 Sartorius Stedim Biotech			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	4.713	3,80	-22		
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
13.922			124.276		
Irland – 3,62 % (28. Februar 2023: 5,88 %)			Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
EUR 50 Kingspan Group Plc			-255		
	4.495	3,62	Gesamtvermögen		
Italien – 8,69 % (28. Februar 2023: 8,65 %)			124.021 \$		
EUR 14 Ferrari NV			100,00		
	5.935	4,79			
EUR 67 Moncler SpA					
	4.839	3,90			
10.774					
Niederlande – 10,18 % (28. Februar 2023: 5,90 %)					
EUR 3 Adyen NV, 144A					
	4.697	3,79			
EUR 8 ASML Holding NV					
	7.930	6,39			
12.627					
Schweden – 8,75 % (28. Februar 2023: 9,97 %)					
SEK 107 Assa Abloy AB					
	3.051	2,46			
SEK 282 Atlas Copco AB					
	4.908	3,96			
SEK 247 Hexagon AB					
	2.893	2,33			
10.852					
Vereinigtes Königreich – 2,10 % (28. Februar 2023: 7,55 %)					
GBP 43 Croda International Plc					
	2.611	2,10			
USA – 51,20 % (28. Februar 2023: 43,39 %)					
AUD 11 Autodesk Inc					
	2.790	2,25			
AUD 14 Cadence Design Systems Inc					
	4.272	3,45			
AUD 18 CSL Ltd					
	3.424	2,76			
AUD 16 Estee Lauder Cos Inc/The 'A'					
	2.343	1,89			
AUD 5 IDEXX Laboratories Inc					
	2.591	2,09			
AUD 31 Illumina Inc					
	4.382	3,53			
AUD 13 Linde Plc					
	5.867	4,73			
AUD 10 Mastercard Inc					
	4.559	3,68			
AUD 2 Mettler-Toledo International Inc					
	3.068	2,47			
AUD 17 Microsoft Corp					
	7.079	5,71			
AUD 23 NIKE Inc					
	2.407	1,94			
AUD 15 NVIDIA Corp					
	11.771	9,49			

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 2.192	Verkauf EUR 2.042	\$ -18
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 211	Verkauf EUR 194	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD 79	Verkauf GBP 62	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 134	Verkauf USD 171	-
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP 2.360	Verkauf USD 2.968	10
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 1.894	Verkauf USD 2.053	-4
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR 70.246	Verkauf USD 75.597	375
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 41 \$)				\$ 385
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.422 \$)				-22
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.381 \$)				\$ 363

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
142 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	142	0,67
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 142 \$)		
	142	0,67
Stammaktien – 57,04 % (28. Februar 2023: 56,65 %)		
Australien – 14,00 % (28. Februar 2023: 13,13 %)		
AUD 74 AGL Energy Ltd	407	1,92
AUD 110 APA Group	562	2,66
AUD 583 Aurizon Holdings Ltd	1.446	6,84
AUD 62 Transurban Group	546	2,58
	2.961	14,00
China – 12,83 % (28. Februar 2023: 13,32 %)		
HKD 386 China Merchants Port Holdings Co Ltd	479	2,27
HKD 5.420 China Tower Corp Ltd, 144A	661	3,12
HKD 1.588 Guangdong Investment Ltd	943	4,46
HKD 1.106 Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	629	2,98
	2.712	12,83
Hongkong – 6,45 % (28. Februar 2023: 5,49 %)		
HKD 74 CLP Holdings Ltd	611	2,89
HKD 226 Wharf Real Estate Investment Co Ltd	752	3,56
	1.363	6,45
Indien – 4,79 % (28. Februar 2023: 7,70 %)		
INR 162 NHPC Ltd	172	0,81
INR 246 Power Grid Corp of India Ltd	842	3,98
	1.014	4,79
Malaysia – 2,86 % (28. Februar 2023: 2,57 %)		
MYR 50 Petronas Gas Bhd	187	0,88
MYR 524 Westports Holdings Bhd	418	1,98
	605	2,86
Neuseeland – 7,23 % (28. Februar 2023: 5,98 %)		
NZD 228 Chorus Ltd	1.093	5,17
NZD 88 Contact Energy Ltd	435	2,06
	1.528	7,23
Philippinen – 1,70 % (28. Februar 2023: 1,10 %)		
53 PHP Manila Electric Co	360	1,70
Singapur – 4,55 % (28. Februar 2023: 4,14 %)		
SGD 772 Capitaland India Trust	582	2,75
SGD 606 NETLINK NBN TRUST	380	1,80
	962	4,55
Thailand – 2,63 % (28. Februar 2023: 3,22 %)		
THB 2.545 Digital Telecommunications Infrastructure Fund	555	2,63
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 13.391 \$)		
	12.060	57,04
Real Estate Investment Trusts – 41,92 % (28. Februar 2023: 42,58 %)		
Australien – 20,10 % (28. Februar 2023: 20,53 %)		
AUD 70 Charter Hall Long Wale REIT	169	0,80
AUD 349 Charter Hall Retail REIT	803	3,80
AUD 233 GPT Group/The	657	3,11
AUD 184 Region RE Ltd	264	1,25
AUD 614 Scentre Group	1.240	5,86
AUD 174 Stockland	507	2,40
AUD 482 Vicinity Ltd	609	2,88
	4.249	20,10

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf AUD	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf AUD	1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf CNH	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SGD	3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SGD	3
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD	Verkauf USD	230
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNH	Verkauf USD	1
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf AUD	Verkauf USD	22
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf CNH	Verkauf USD	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf SGD	Verkauf USD	3
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1 \$)				–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -19 \$)				–
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -18 \$)				–

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hongkong – 8,61 % (28. Februar 2023: 8,91 %)		
HKD 1.152 Fortune Real Estate Investment Trust	662	3,13
HKD 234 Link REIT	1.157	5,48
	1.819	8,61
Indien – 6,31 % (28. Februar 2023: 4,22 %)		
INR 292 Embassy Office Parks REIT	1.335	6,31
Neuseeland – 1,96 % (28. Februar 2023: 2,04 %)		
NZD 810 Kiwi Property Group Ltd	415	1,96
Singapur – 4,94 % (28. Februar 2023: 6,88 %)		
SGD 249 Capitaland Integrated Commercial Trust	364	1,72
SGD 106 Frasers Centrepoint Trust	173	0,81
SGD 298 Mapletree Industrial Trust	509	2,41
	1.046	4,94
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 10.040 \$)		
	8.864	41,92
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 23.573 \$)		
	21.066	99,63
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	–	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	21.066	99,63
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: -0,07 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	–	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	–	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	21.066	99,63
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	78	0,37
Gesamtvermögen		
	21.144 \$	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 661.000 USD und machten 3,12 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
HKD	– Hongkong-Dollar
INR	– Indische Rupie
MYR	– Malaysischer Ringgit
NZD	– Neuseeland-Dollar
PHP	– Philippinischer Peso
SGD	– Singapur-Dollar
THB	– Thailändischer Baht

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,77
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,65
Sonstige Vermögenswerte	3,58
Gesamtvermögen	100,00

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert					
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,33 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Taiwan – 12,76 % (28. Februar 2023: 12,47 %)							
420	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	420	1,33	TWD	46	Delta Electronics Inc	429	1,36		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 420 \$)			USA – 3,06 % (28. Februar 2023: 2,42 %)							
		420	1,33	TWD	28	Globalwafers Co Ltd	494	1,56		
Stammaktien – 99,24 % (28. Februar 2023: 99,55 %)			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 37.296 \$)							
Brasilien – 6,81 % (28. Februar 2023: 6,02 %)			31.406			99,24				
BRL	169	B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	436	1,38	1	EPAM Systems Inc	272	0,86		
BRL	166	Cosan SA	568	1,80	3	Globant SA	697	2,20		
		– MercadoLibre Inc	359	1,13	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
BRL	104	Odontoprev SA	253	0,80	31.826			100,57		
BRL	73	WEG SA	538	1,70	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
		2.154	6,81	31.826			100,57			
Chile – 2,52 % (28. Februar 2023: 2,16 %)			Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten			-179			-0,57	
GBP	35	Antofagasta Plc	797	2,52	Gesamtvermögen			31.647 \$	100,00	
China – 20,48 % (28. Februar 2023: 28,67 %)			144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 607.000 USD und machten 1,92 % des Nettovermögens aus.							
HKD	55	Alibaba Group Holding Ltd	510	1,61	ABKÜRZUNGEN:					
HKD	6	Alibaba Group Holding Ltd ADR	418	1,32	ADR	– American Depositary Receipt				
HKD	141	China Merchants Bank Co Ltd	546	1,72	BRL	– Brasilianischer Real				
CNH	17	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	378	1,19	CNH	– Chinesischer Renminbi				
HKD	4	JD.com Inc	50	0,16	GBP	– Britisches Pfund Sterling				
HKD	10	JD.com Inc ADR	225	0,71	HKD	– Hongkong-Dollar				
HKD	42	Meituan 'B', 144A	424	1,34	IDR	– Indonesische Rupiah				
HKD	226	Mint Group Ltd	384	1,22	INR	– Indische Rupie				
HKD	108	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	481	1,52	KRW	– Südkoreanischer Won				
CNH	17	Proya Cosmetics Co., Ltd	248	0,78	MXN	– Mexikanischer Peso				
HKD	111	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	200	0,63	PHP	– Philippinischer Peso				
CNH	47	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	407	1,29	SAR	– Saudi-Riyal				
CNH	4	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd.	156	0,49	TWD	– Taiwanesischer Dollar				
HKD	49	Tencent Holdings Ltd	1.726	5,46	ZAR	– Südafrikanischer Rand				
HKD	78	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	183	0,58	Verteilung des Gesamtvermögens			% des Gesamtvermögens		
HKD	240	Xinyi Solar Holdings Ltd	146	0,46	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			98,27		
		6.482	20,48	Organismen für gemeinsame Anlagen			1,31			
Hongkong – 1,97 % (28. Februar 2023: 2,94 %)			Indien – 20,62 % (28. Februar 2023: 17,02 %)			Sonstige Vermögenswerte			0,42	
HKD	77	AIA Group Ltd	624	1,97	Gesamtvermögen			100,00		
INR	11	Asian Paints Ltd	374	1,18						
INR	65	HDFC Bank Ltd	1.107	3,50						
INR	81	ICICI Bank Ltd	1.034	3,27						
INR	24	Kotak Mahindra Bank Ltd	489	1,55						
INR	4	Maruti Suzuki India Ltd	568	1,79						
INR	30	Reliance Industries Ltd	1.061	3,35						
INR	11	Tata Consultancy Services Ltd	535	1,69						
INR	20	Titan Co Ltd	896	2,83						
INR	4	UltraTech Cement Ltd	461	1,46						
		6.525	20,62							
Indonesien – 4,57 % (28. Februar 2023: 3,54 %)			Mexiko – 4,78 % (28. Februar 2023: 4,57 %)							
IDR	927	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	353	1,11	MXN	71	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	733	2,32	
IDR	1.920	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	750	2,37	MXN	117	Orbia Advance Corp SAB de CV	216	0,68	
IDR	1.352	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	344	1,09	MXN	141	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	563	1,78	
		1.447	4,57				1.512	4,78		
Peru – 0,87 % (28. Februar 2023: 1,15 %)			Philippinen – 0,31 % (28. Februar 2023: 0,43 %)							
		2	Credicorp Ltd	276	0,87	PHP	148	Robinsons Retail Holdings Inc	99	0,31
Saudi-Arabien – 2,87 % (28. Februar 2023: 1,78 %)			Südafrika – 1,23 % (28. Februar 2023: 0,00 %)							
SAR	29	Al Rajhi Bank	683	2,16	ZAR	4	Capitec Bank Holdings Ltd	389	1,23	
SAR	3	Dr. Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	226	0,71	Südkorea – 16,39 % (28. Februar 2023: 15,91 %)					
		909	2,87	KRW	1	LG Chem Ltd	429	1,36		
Südkorea – 16,39 % (28. Februar 2023: 15,91 %)			Südkorea – 16,39 % (28. Februar 2023: 15,91 %)							
KRW	1	LG Energy Solution Ltd	85	0,27	KRW	2	NAVER Corp	268	0,85	
KRW	50	Samsung Electronics Co Ltd	2.761	8,72	KRW	50	Samsung Electronics Co Ltd	2.761	8,72	
KRW	1	Samsung SDI Co Ltd	249	0,79	KRW	12	SK Hynix Inc	1.394	4,40	
KRW	12	SK Hynix Inc	1.394	4,40				5.186	16,39	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 98,91 % (28. Februar 2023: 99,83 %)			USD 7 Mettler-Toledo International Inc		
Dänemark – 3,82 % (28. Februar 2023: 3,76 %)			18.400 9,74		
DKK 59 Coloplast A.S	7.211	3,82	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 177.839 €)		
Frankreich – 18,79 % (28. Februar 2023: 21,05 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 177.839 €)		
173 Dassault Systemes SE	7.511	3,98	186.811 98,91		
14 Kering SA	6.053	3,20	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,01 %)		
22 L'Oreal SA	9.893	5,24	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
27 Pernod Ricard SA	4.160	2,20	3 –		
31 Sartorius Stedim Biotech	7.877	4,17	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	35.494	18,79	186.814 98,91		
Deutschland – 5,97 % (28. Februar 2023: 7,65 %)			Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,01 %)		
80 Infineon Technologies AG	2.665	1,41	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
97 Nemetschek SE	8.614	4,56	-9 –		
	11.279	5,97	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Irland – 4,84 % (28. Februar 2023: 6,83 %)			-9 –		
109 Kingspan Group Plc	9.148	4,84	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Italien – 16,43 % (28. Februar 2023: 15,71 %)			186.805 98,91		
46 Ferrari NV	18.152	9,61	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
193 Moncler SpA	12.877	6,82	2.073 1,09		
	31.029	16,43	Gesamtnettovermögen		
Niederlande – 17,23 % (28. Februar 2023: 8,94 %)			188.878 € 100,00		
5 Adyen NV, 144A	7.420	3,93	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
21 ASML Holding NV	18.024	9,54	144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7.420.000 EUR und machten 3,93 % des Nettovermögens aus.		
42 BE Semiconductor Industries NV	7.089	3,76	ABKÜRZUNGEN:		
	32.533	17,23	CHF – Schweizer Franken		
Schweden – 13,41 % (28. Februar 2023: 13,48 %)			DKK – Dänische Krone		
SEK 330 Assa Abloy AB	8.742	4,63	GBP – Britisches Pfund Sterling		
SEK 555 Atlas Copco AB	8.930	4,73	SEK – Schwedische Kronen		
SEK 707 Hexagon AB	7.652	4,05	USD – US-Dollar		
	25.324	13,41	Verteilung des Gesamtvermögens		
Schweiz – 4,51 % (28. Februar 2023: 3,36 %)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
CHF 6 Partners Group Holding AG	8.516	4,51	98,84		
Vereinigtes Königreich – 4,17 % (28. Februar 2023: 12,44 %)			Finanzderivate		
GBP 99 Croda International Plc	5.533	2,93	–		
GBP 1.508 Oxford Nanopore Technologies Plc	2.344	1,24	Sonstige Vermögenswerte		
	7.877	4,17	1,16		
USA – 9,74 % (28. Februar 2023: 6,61 %)			Gesamtvermögen		
USD 25 Linde Plc	10.354	5,48	100,00		

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR 761	Verkauf BRL 4.108	€ -3
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR 25	Verkauf BRL 136	–
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf	BRL 125	Verkauf EUR 23	–
4. März 2024	BNY Mellon	Kauf	BRL 4.120	Verkauf EUR 773	-6
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD 64	Verkauf EUR 60	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	USD 2	Verkauf EUR 2	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf	EUR 1	Verkauf USD –	–
2. April 2024	BNY Mellon	Kauf	BRL 4.089	Verkauf EUR 755	3
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 22 €)				€ 3	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): (20) €)				-9	
Nettoverwertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2 €)				€ -6	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Stammaktien – 99,00 %			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 6.132 \$)			
Brasilien – 5,36 %			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 6.132 \$)			
–	MercadoLibre Inc	332	5,36			
Dänemark – 5,81 %			Devisenterminkontrakte – 0,08 %			
DKK	6 Novozymes A.S	359	5,81	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Frankreich – 4,74 %			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
EUR	9 Veolia Environnement SA	293	4,74	6.129 99,08		
Indien – 4,82 %			Devisenterminkontrakte – 0,00 %			
6	HDFC Bank Ltd ADR	298	4,82	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Indonesien – 3,18 %			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			
IDR	503 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	197	3,18	– –		
Italien – 4,26 %			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
EUR	8 Amplifon SpA	264	4,26	6.129 99,08		
Japan – 1,15 %			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			
JPY	5 LITALICO Inc	71	1,15	57 0,92		
Nigeria – 3,47 %			Gesamtvermögen			
GBP	179 Airtel Africa Plc, 144A	215	3,47	6.186 \$ 100,00		
Schweden – 1,54 %			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.			
SEK	3 MIPS AB	95	1,54	144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 29. Februar 2024 beliefen sich diese Wertpapiere auf 215.000 USD und machten 3,47 % des Nettovermögens aus.		
Vereinigte Arabische Emirate – 1,80 %			ABKÜRZUNGEN:			
AED	249 Emirates Central Cooling Systems Corp	111	1,80	ADR – American Depositary Receipt		
Vereinigtes Königreich – 9,80 %			AED – Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate			
GBP	4 Croda International Plc	270	4,36	DKK – Dänische Krone		
GBP	12 FDM Group Holdings Plc	58	0,94	EUR – Euro		
GBP	16 Mears Group Plc	73	1,19	GBP – Britisches Pfund Sterling		
GBP	15 Vistry Group Plc	205	3,31	IDR – Indonesische Rupiah		
			JPY – Japanischer Yen			
			SEK – Schwedische Kronen			
USA – 53,07 %			Verteilung des Gesamtvermögens			
6	Coursera Inc	97	1,57	Gesamtvermögens		
1	Deere & Co	239	3,86	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
1	Ecolab Inc	302	4,88	97,97		
5	Energy Recovery Inc	77	1,24	Finanzderivate		
3	Everbridge Inc	77	1,25	0,08		
2	Illumina Inc	231	3,74	Sonstige Vermögenswerte		
1	Intuitive Surgical Inc	464	7,51	1,95		
2	Masimo Corp	215	3,48	Gesamtvermögen		
2	Planet Fitness Inc 'A'	95	1,53	100,00		
3	Revvity Inc	327	5,29			
2	Stride Inc	99	1,59			
1	Valmont Industries Inc	249	4,03			
1	Veeva Systems Inc 'A'	283	4,57			
5	Verra Mobility Corp 'A'	98	1,59			
3	Xylem Inc.NY	430	6,94			
			3.283 53,07			

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ minderung aus Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	2 Verkauf EUR	\$ –
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf USD	24 Verkauf GBP	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	13 Verkauf USD	–
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf GBP	1.078 Verkauf USD	5
15. März 2024	BNY Mellon	Kauf EUR	91 Verkauf USD	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten				\$ 5
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten				–
Nettowersteigerung aus Devisenterminkontrakten				\$ 5

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]

Anlagenportfolio zum 29. Februar 2024

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 95,43 % (28. Februar 2023: 92,33 %)			Spanien – 7,24 % (28. Februar 2023: 9,71 %)		
Australien – 1,31 % (28. Februar 2023: 1,34 %)			1300 Abertis Infraestructuras SA, 4,125 %, fällig am 31.01.2028 1.311 1,49		
1300 Macquarie Group Ltd, 0,350 %, fällig am 03.03.2028	1.150	1,31	400 Arena Luxembourg Finance Sarl, 1,875 %, fällig am 01.02.2028	361	0,41
Belgien – 2,49 % (28. Februar 2023: 2,19 %)			1000 Banco de Sabadell SA, 5,250 %, fällig am 07.02.2029 * 1.033 1,18		
900 Azelis Finance NV, 5,750 %, fällig am 15.03.2028	930	1,06	1400 CaixaBank SA, 0,750 %, fällig am 26.05.2028 * 1.272 1,45		
1200 Crelan SA, 5,750 %, fällig am 26.01.2028	1.252	1,43	300 Ibercaja Banco SA, 4,375 %, fällig am 30.07.2028 * 302 0,34		
	2.182	2,49	800 Unicaja Banco SA, 7,250 %, fällig am 15.11.2027 * 856 0,98		
China – 1,20 % (28. Februar 2023: 1,32 %)			1200 Werfen SA/Spain, 4,625 %, fällig am 06.06.2028 1.216 1,39		
1200 Prosus NV, 1,539 %, fällig am 03.08.2028	1.056	1,20	Schweden – 5,30 % (28. Februar 2023: 2,67 %)		
Tschechische Republik – 1,44 % (28. Februar 2023: 1,77 %)			1600 Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375 %, fällig am 21.06.2028 1.385 1,58		
1300 CEZ AS, 3,000 %, fällig am 05.06.2028	1.258	1,44	1200 Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, fällig am 01.11.2027 1.214 1,39		
Dänemark – 3,88 % (28. Februar 2023: 1,57 %)			600 Swedbank AB, Series gmn, 4,250 %, fällig am 11.07.2028 608 0,69		
1000 Danske Bank A/S, 4,500 %, fällig am 09.11.2028 *	1.018	1,16	500 Verisure Holding AB, 9,250 %, fällig am 15.10.2027 535 0,61		
1400 H Lundbeck A.S., 0,875 %, fällig am 14.10.2027	1.253	1,43	900 Volvo Car AB, 4,250 %, fällig am 31.05.2028 903 1,03		
1300 Nykredit Realkredit AS, 0,375 %, fällig am 17.01.2028	1.135	1,29	Schweiz – 2,56 % (28. Februar 2023: 2,49 %)		
	3.406	3,88	1000 Cloverie Plc für Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig am 15.12.2028 921 1,05		
Finnland – 1,49 % (28. Februar 2023: 1,55 %)			1300 UBS Group AG, 4,625 %, fällig am 17.03.2028 * 1.324 1,51		
1500 OP Corporate Bank plc, 0,375 %, fällig am 16.06.2028	1.303	1,49	Vereinigtes Königreich – 12,16 % (28. Februar 2023: 14,60 %)		
Frankreich – 19,20 % (28. Februar 2023: 16,09 %)			1500 Barclays Plc, 0,877 %, fällig am 28.01.2028 * 1.380 1,57		
600 Adevinta ASA, 3,000 %, fällig am 15.11.2027	604	0,69	1300 easyJet FinCo BV, 1,875 %, fällig am 03.03.2028 1.210 1,38		
1100 ALD SA, 3,875 %, fällig am 24.01.2028	1.097	1,25	1500 Motability Operations Group Plc, 0,125 %, fällig am 20.07.2028 1.295 1,48		
500 Altice France SA/France, 3,375 %, fällig am 15.01.2028	408	0,47	1500 National Grid Plc, 0,163 %, fällig am 20.01.2028 1.310 1,49		
1500 BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig am 19.02.2028 *	1.361	1,55	1400 Nationwide Building Society, 0,250 %, fällig am 14.09.2028 1.212 1,38		
1200 BPCE SA, 4,375 %, fällig am 13.07.2028	1.220	1,39	1200 NatWest Markets Plc, 4,250 %, fällig am 13.01.2028 1.229 1,40		
600 CAB SELAS, 3,375 %, fällig am 01.02.2028	547	0,62	1300 Sage Group Plc/The, 3,820 %, fällig am 15.02.2028 1.314 1,50		
1400 Credit Agricole SA, 0,375 %, fällig am 20.04.2028	1.225	1,40	1400 Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, fällig am 25.08.2028 * 1.378 1,57		
1500 Engie SA, 1,750 %, fällig am 27.03.2028	1.398	1,59	400 Victoria Plc, 3,625 %, fällig am 24.08.2026 340 0,39		
1400 Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625 %, fällig am 27.11.2027	1.303	1,49	USA – 15,78 % (28. Februar 2023: 14,75 %)		
320 Iliad Holding SASU, 5,625 %, fällig am 15.10.2028	319	0,36	600 Avantor Funding Inc, 3,875 %, fällig am 15.07.2028 586 0,67		
300 Iliad SA, 1,875 %, fällig am 11.02.2028	274	0,31	640 Berry Global Inc, 1,500 %, fällig am 15.01.2027 600 0,68		
1300 La Banque Postale SA, 1,000 %, fällig am 09.02.2028 *	1.193	1,36	300 Carrier Global Corp, 4,125 %, fällig am 29.05.2028 305 0,35		
1300 Orano SA, 2,750 %, fällig am 08.03.2028	1.247	1,42	200 Coty Inc, 5,750 %, fällig am 15.09.2028 208 0,24		
200 Paprec Holding SA, 6,500 %, fällig am 17.11.2027	210	0,24	1000 Crown European Holdings SA, 5,000 %, fällig am 15.05.2028 1.025 1,17		
1000 RCI Banque SA, 4,875 %, fällig am 21.09.2028	1.037	1,18	1400 DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, fällig am 15.09.2027 1.238 1,41		
900 Rexel SA, 2,125 %, fällig am 15.12.2028	830	0,95	1300 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, fällig am 22.03.2028 1.221 1,39		
1500 Societe Generale SA, 0,125 %, fällig am 18.02.2028	1.311	1,50	800 IQVIA Inc, 2,250 %, fällig am 15.01.2028 742 0,85		
1200 TDF Infrastructure SASU, 5,625 %, fällig am 21.07.2028	1.258	1,43	1400 JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, fällig am 18.05.2028 * 1.312 1,50		
	16.842	19,20	1200 LKQ European Holdings BV, 4,125 %, fällig am 01.04.2028 1.203 1,37		
Deutschland – 2,51 % (28. Februar 2023: 3,54 %)			1000 Morgan Stanley, 4,813 %, fällig am 25.10.2028 * 1.035 1,18		
1200 Commerzbank AG, 4,625 %, fällig am 21.03.2028 *	1.214	1,38	1300 PVH Corp, 3,125 %, fällig am 15.12.2027 1.267 1,44		
1000 Deutsche Lufthansa AG, 3,750 %, fällig am 11.02.2028	986	1,13	900 Schneider Electric SE, 1,500 %, fällig am 15.01.2028 844 0,96		
	2.200	2,51	1500 Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500 %, fällig am 01.03.2028 1.343 1,53		
Irland – 3,05 % (28. Februar 2023: 3,05 %)			1000 Verizon Communications Inc, 1,375 %, fällig am 02.11.2028 914 1,04		
1400 AIB Group Plc, 2,250 %, fällig am 04.04.2028 *	1.334	1,52	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 82.295 €) 83.695 95,43		
1300 Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, fällig am 16.07.2028 *	1.343	1,53	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 2,08 % (28. Februar 2023: 2,07 %)		
	2.677	3,05	Rumänien – 2,08 % (28. Februar 2023: 2,07 %)		
Italien – 5,01 % (28. Februar 2023: 7,49 %)			2000 Rumänien, internationale Staatsanleihe, 2,125 %, fällig am 07.03.2028 1.829 2,08		
900 Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, fällig am 25.01.2028	830	0,95	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.775 €) 1.829 2,08		
350 IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3,750 %, fällig am 15.01.2028	335	0,38	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 85.524 97,51		
1500 Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, fällig am 20.03.2028	1.393	1,59	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 85.524 97,51		
400 Italmatch Chemicals SpA, 10,000 %, fällig am 06.02.2028	421	0,48	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte 2.180 2,49		
1000 Mundys SpA, 1,875 %, fällig am 12.02.2028	914	1,04	Gesamnettovermögen 87.704 € 100,00		
500 TeamSystem SpA, 7,692 %, fällig am 15.02.2028 *	501	0,57	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
	4.394	5,01	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 29. Februar 2024.		
Japan – 1,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)			Verteilung des Gesamtvermögens % des Gesamtvermögens		
1000 NTT Finance Corp, 0,399 %, fällig am 13.12.2028	872	1,00	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 97,42		
Luxemburg – 2,11 % (28. Februar 2023: 3,14 %)			Sonstige Vermögenswerte 2,58		
1500 Logicor Financing Sarl, 4,625 %, fällig am 25.07.2028	1.504	1,71	Gesamtvermögen 100,00		
350 Matterhorn Telecom SA, 4,000 %, fällig am 15.11.2027	348	0,40			
	1.852	2,11			
Niederlande – 4,85 % (28. Februar 2023: 2,14 %)					
1300 ABN AMRO Bank NV, 4,000 %, fällig am 16.01.2028	1.315	1,50			
1200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig am 27.01.2028 *	1.229	1,40			
1300 ING Groep NV, 4,875 %, fällig am 14.11.2027 *	1.333	1,52			
400 TenneT Holding BV, 1,375 %, fällig am 05.06.2028	375	0,43			
	4.252	4,85			
Norwegen – 1,51 % (28. Februar 2023: 0,00 %)					
1500 Telenor ASA, 0,250 %, fällig am 14.02.2028	1.327	1,51			
Portugal – 1,34 % (28. Februar 2023: 2,24 %)					
1100 Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, fällig am 31.10.2028 *	1.172	1,34			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz

(in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 1	\$ 1	\$ –	\$ –	\$ 11.569	\$ 34.310	€ 1.317	€ 4.251
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	1.697	2.060	4.243	7.065	1.090	2.191
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	1.126.235	844.196	190.499	140.166	813.413	1.183.129	47.809	125.838
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	102	64	460	556	–	4
Swapkontrakte	–	–	1.346	2.534	10.341	8.276	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	416	540	16	72
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	156	303	1.495	2.474	9	476
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	2.944	1.429	9.664	17.093	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	109	53	1.264	429	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	2.161	2.036	1.419	1.107	6.463	8.995	473	1.280
Dividendenforderungen	–	–	17	8	7	10	13	31
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	1.128.397	846.233	198.289	147.724	859.335	1.262.877	50.727	134.143
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	1.402	620	1.193	849	60	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	1.640	2.826	5.946	445	7	9
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	740	–	5.842	–	–	–
Optionen	–	–	70	70	215	615	–	4
Swapkontrakte	–	–	1	46	1.640	1.867	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	1.408	2.578	15	338
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	75	180	552	3.625	224	1.065
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 4)	9.918	9.879	8.473	11.726	24.808	101.191	525	187
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.318	2.054	166	132	158	148	2	1
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	513	363	95	71	385	487	3	3
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	30	24	18	16	57	73	8	14
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	9	1	20	20	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	49	1	1.503	1.904	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	200	298	91	116	353	375	54	55
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	13.979	12.618	12.829	15.805	44.080	114.177	898	1.676
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 1.114.418	\$ 833.615	\$ 185.460	\$ 131.919	\$ 815.255	\$ 1.148.700	€ 49.829	€ 132.467
(in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short- Term Government Fund [^]		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	
	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 1.100	\$ 3.850	\$ 15	\$ 14	\$ 17	\$ 17	\$ 12	\$ 45
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	101	162	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	47.559	52.716	–	–	–	–	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	34	60	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	8	38	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	295	554	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	59	4	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	673	739	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	49.829	58.123	15	14	17	17	12	45
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	235	140	–	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	8	38	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	24	271	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	736	4	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	90	89	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	33	41	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	10	11	–	–	–	–	–	3
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1	4	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	103	–	1	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	70	94	14	14	17	17	12	42
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	1.310	692	15	14	17	17	12	45
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 48.519	\$ 57.431	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^	
Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
\$ 675	\$ 1.425	\$ 15.928	\$ 20.391	\$ 682	\$ 63	\$ 23	\$ 60	\$ 18	\$ 35
-	-	1.402	882	1.418	1.126	-	-	-	-
-	-	222.636	202.891	96.006	123.407	-	-	-	-
-	-	1	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	421	102	-	-	-	-
-	-	364	775	14	1	-	-	-	-
-	-	43	74	8	-	-	-	-	-
-	-	221	4.780	179	608	-	-	-	-
-	-	245	28	27	8	-	-	-	-
-	-	2.793	2.851	1.557	1.920	-	-	-	-
-	-	16	15	4	5	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1	-	-	-	-	-	2	-	-
675	1.426	243.649	232.687	100.316	127.240	23	62	18	35
-	-	-	559	-	155	-	-	-	-
-	-	39	27	237	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	219	116	-	-	-	-
-	-	1.576	4.011	1	35	-	-	-	-
-	-	139	29	-	31	-	-	-	-
-	-	541	266	2.660	1.250	-	-	-	-
-	12	86	94	163	172	-	-	-	-
-	14	94	91	57	67	-	-	-	-
2	9	22	20	13	14	-	3	-	3
-	2	6	6	5	7	-	-	-	-
662	1.366	102	45	35	74	11	11	-	-
11	23	104	184	48	79	12	48	18	32
675	1.426	2.709	5.332	3.438	2.000	23	62	18	35
\$ -	\$ -	\$ 240.940	\$ 227.355	\$ 96.878	\$ 125.240	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		FTGF Western Asset Global Credit Fund^		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^	
Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
\$ 48	\$ 998	\$ 3.781	\$ 3.559	\$ 3.684	\$ 4.735	\$ 211	\$ 743	€ 12	€ 31
550	1.540	3.313	2.733	1.024	1.544	1.107	1.074	-	-
248.280	433.473	464.601	532.162	138.973	146.874	29.411	43.765	-	-
-	-	-	-	-	152	-	-	-	-
-	-	-	-	1	19	-	-	-	-
-	-	-	213	-	-	-	-	-	-
34	162	2.849	3.707	542	1.011	90	343	-	-
-	-	638	4.839	52	338	82	202	-	-
220	771	363	2.646	411	3.576	52	1	-	-
461	41	295	2.043	-	1	-	1	-	-
2.578	4.375	4.644	2.855	990	1.086	368	491	-	-
64	20	46	127	13	15	4	6	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	1	-	-	-	-	-	-
252.235	441.380	480.530	554.885	145.690	159.351	31.325	46.626	12	31
236	522	2	484	8	-	29	-	-	-
1	6	5	1	123	17	23	3	-	-
-	-	-	-	412	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	4	-	-	-	-
-	-	498	-	-	-	188	76	-	-
182	1.130	177	3.219	371	2.097	1	90	-	-
82	373	82	61	230	1.043	21	34	-	-
219	770	364	25.758	14.941	9.282	-	306	-	-
15	15	2	2	-	-	-	-	-	-
151	200	142	153	14	17	1	2	-	-
26	32	36	36	15	15	8	9	-	3
13	13	12	11	-	-	-	-	-	-
523	299	590	1.106	25	72	-	-	-	-
159	313	82	84	131	101	57	56	12	28
1.607	3.673	1.992	30.915	16.270	12.648	328	576	12	31
\$ 250.628	\$ 437.707	\$ 478.538	\$ 523.970	\$ 129.420	\$ 146.703	\$ 30.997	\$ 46.050	€ -	€ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
	UMLAUFVERMÖGEN:							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 26.798	\$ 63.691	\$ –	\$ 30	\$ 4.674	\$ 3.203	\$ –	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	33.984	250.586	–	–	3.657	3.915	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	1.150.354	1.913.653	–	–	361.536	267.865	–	–
Verpfändete Anlagen	69.547	1.590	–	–	–	–	–	–
Optionen	5.129	6.090	–	–	93	566	–	–
Swapkontrakte	82.650	155.867	–	–	232	1.033	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	8.511	21.504	–	–	1.501	536	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	18.244	20.467	–	–	620	53	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	1.403	13.260	–	–	1.216	5.180	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	445	1.024	–	–	459	2.133	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	19.663	36.399	–	–	4.748	3.427	–	–
Dividendenforderungen	332	487	–	–	8	8	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	1	–	–
Gesamtumlaufermögen	1.417.060	2.484.618	–	30	378.744	287.920	–	–
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	4	83.849	–	–	1.022	2	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	56.547	76.579	–	–	119	119	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	7.886	46.352	–	–	17	36	–	–
Swapkontrakte	18.195	43.002	–	–	286	761	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	6.458	43.616	–	–	403	2.965	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	19.662	47.194	–	–	253	890	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	97.494	4.384	–	–	3.733	7.800	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	1.269	2.062	–	–	27	24	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	80	151	–	–	29	22	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	104	136	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.476	3.140	–	–	4	82	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	916	1.652	–	30	170	207	–	–
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	212.091	352.117	–	30	6.063	12.908	–	–
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 1.204.969	\$ 2.132.501	\$ –	\$ –	\$ 372.681	\$ 275.012	\$ –	\$ –

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^] ¥		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
	UMLAUFVERMÖGEN:							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 41	\$ 136	\$ –	\$ 223	\$ 13	\$ 1.762	\$ 80	\$ 5
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	194	–	–	1.146	2.709	68	8
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	–	8.571	145.313	164.330	146.547	538.707	30.535	10.360
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	92	855	3.132	3.036	13.024	38	10
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	59	–	–	256	2.190	1	2
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	155	139	490	3.081	1.798	412	248
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	138	117	1	1.797	–	1
Zinsen und sonstige Erträge	–	104	1.469	1.781	1.371	5.523	501	175
Dividendenforderungen	–	1	357	345	123	233	5	2
Verwaltungsgebühren	–	2	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	8	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufermögen	41	9.322	148.271	170.418	155.574	567.743	31.640	10.811
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	79	4	9	7	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	26	–	850	270	2.495	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	107	2.346	3.966	3.927	23.627	71	202
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	5	–	–	51	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	145	139	490	2.526	1.798	287	163
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	8	1
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	72	83	101	260	1	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	11	13	18	24	16	38	8	7
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	10	11	1	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	179	2.595	2.176	–	60	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	30	31	343	386	228	247	41	44
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	41	327	3.186	8.409	9.305	28.472	476	417
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ –	\$ 8.995	\$ 145.085	\$ 162.009	\$ 146.269	\$ 539.271	\$ 31.164	\$ 10.394

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^] _θ		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^] _μ		Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	
Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
\$ 3.392 1.450	\$ 1.723 629	\$ 73 2.654	\$ 416 4.167	£ 46 -	£ 1.256 297	\$ 123 -	\$ 1.005 978	\$ 196 328	\$ 136 541
519.423	557.051	1.178.166	1.148.337	-	43.921	-	94.192	17.621	17.280
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	32	19
12	8	-	-	-	27	-	35	490	899
166	317	313	353	-	45	-	4	20	11
-	-	224.075	46.919	-	-	-	-	74	156
-	-	-	-	-	-	-	-	-	99
899	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.040	1.998	4.961	4.402	-	686	-	1.007	174	173
84	45	72	5	-	-	-	8	1	5
-	-	-	-	-	-	-	-	8	4
-	-	-	-	-	1	-	-	-	1
527.466	561.771	1.410.314	1.204.599	46	46.233	123	97.229	18.944	19.324
533	-	3.121	878	-	-	-	-	119	-
-	-	72	-	-	-	-	6	105	389
-	-	-	54	-	-	-	-	-	-
-	-	6.335	-	-	-	-	-	18	38
-	-	-	-	-	-	-	74	4	2
6	1.683	-	-	-	7	-	404	62	58
306	73	247	731	-	29	-	103	39	120
-	-	250.542	83.125	-	229	-	1.787	137	193
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
43	77	15	13	-	-	-	4	-	-
39	38	77	69	3	11	6	12	17	31
1	2	-	-	-	-	-	-	-	-
98	-	-	-	-	-	28	-	-	-
284	350	197	222	43	45	89	64	47	52
1.310	2.223	260.606	85.092	46	321	123	2.454	548	883
\$ 526.156	\$ 559.548	\$ 1.149.708	\$ 1.119.507	£ -	£ 45.912	\$ -	\$ 94.775	\$ 18.396	\$ 18.441
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^] _α	
Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
\$ - 320	\$ 422 -	\$ 2.172 -	\$ 2.172 -	\$ 2 5.330	\$ 32.149 25.134	\$ - -	\$ - 980	\$ 15 -	\$ - -
207.752	204.726	-	-	1.141.005	1.153.805	18.003	45.793	-	8.488
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1.309	-	-	-	-
942	1.448	-	-	6.119	3.510	-	403	-	-
-	-	-	-	55	-	-	69	-	-
-	9.346	-	-	894	838	4.373	-	-	134
1	-	-	-	2.418	2.452	-	-	-	-
2.171	2.543	-	-	16.923	15.517	246	215	-	137
629	601	-	-	89	337	3	11	-	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	21
-	-	-	-	-	8	-	1	-	-
211.815	219.086	2.172	2.172	1.172.835	1.235.059	22.625	47.472	15	8.782
1 320	3 110	-	-	3.226	1	152	-	-	103
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	2.085	878	-	37	-	-
3.847	4.239	-	-	4.746	12.389	-	379	-	192
-	-	-	-	274	3.704	-	175	-	-
-	9.308	-	-	4.968	5.978	663	-	-	30
-	-	-	-	147	106	-	-	-	-
105	100	-	-	681	701	3	39	-	-
22	27	-	-	82	77	13	20	2	7
-	1	-	-	74	78	-	-	-	1
16	4	-	-	4.823	714	5.311	-	-	-
128	148	2.172	2.172	349	128	80	66	13	60
4.439	13.940	2.172	2.172	21.455	24.754	6.222	716	15	393
\$ 207.376	\$ 205.146	\$ -	\$ -	\$ 1.151.380	\$ 1.210.305	\$ 16.403	\$ 46.756	\$ -	\$ 8.389

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	
	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 15	\$ –	\$ 2.984	\$ 1.879	\$ 37	\$ 1.147	\$ –	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	1.171	664	63	431	1.087	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	–	–	67.598	69.694	15.831	13.130	30.675	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	33	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	430	249	54	86	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	14	–	1	–	14	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	327	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	930	948	194	186	163	–
Dividendenforderungen	–	–	7	9	2	–	2	–
Verwaltungsgebühren	–	–	4	–	3	5	1	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	4	–	–
Gesamtumlautvermögen	15	–	73.138	73.770	16.185	15.022	31.942	–
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	1	1	9	–	218	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	288	122	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	1.463	3.482	57	64	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	167	283	4	123	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	327	209	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	11	13	20	4	4	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	15	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	171	132	57	27	21	–
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	15	–	2.101	4.360	356	218	243	–
Summe des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ –	\$ –	\$ 71.037	\$ 69.410	\$ 15.829	\$ 14.804	\$ 31.699	\$ –

	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	
	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 62.331	\$ 54.486	\$ 2.718	\$ 11.596	\$ 219	\$ 2.053	\$ 9.574	\$ 11.074
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	290	530	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	1.827.864	1.172.787	205.138	214.039	35.857	36.590	1.367.716	1.629.033
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	392	286	7	4	3	1	370	22
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	1.083	2.355	28	179	3	–	9.448	3.682
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	2.610	1.211	115	5	1	–	1.647	29.209
Zinsen und sonstige Erträge	109	67	2	14	11	7	6	20
Dividendenforderungen	1.409	1.120	86	42	41	72	658	740
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	4
Gesamtumlautvermögen	1.896.088	1.232.842	208.094	225.879	36.135	38.723	1.389.419	1.673.784
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	2	5	–	–	74	–	5.786	7
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	312	1.551	22	229	3	56	16	840
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	18.684	429	28	179	3	–	10.962	3.682
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	1.176	795	196	200	20	33	583	704
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	189	165	40	43	10	11	105	130
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	154	109	36	35	–	4	115	170
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.792	3.685	208	176	34	44	6.183	28.161
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	179	368	174	224	55	47	159	111
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	23.488	7.107	704	1.086	199	195	23.909	33.805
Summe des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 1.872.600	\$ 1.225.735	\$ 207.390	\$ 224.793	\$ 35.936	\$ 38.528	\$ 1.365.510	\$ 1.639.979

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^α			FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund ^α		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund ^α		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023		Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
\$ 22	\$ -		\$ 17.644	\$ 12.361	\$ 17	\$ 59	\$ 1	\$ 55	\$ 1.969	\$ 9.110
-	-		-	-	-	-	-	-	-	-
-	2.583		1.142.135	921.986	-	-	-	-	210.196	180.681
-	-		-	-	-	-	-	-	-	-
-	-		-	-	-	-	-	-	-	-
-	-		622	10	-	-	-	-	-	-
-	-		-	-	-	-	-	-	-	-
-	-		3.823	4.380	-	-	-	-	-	43
-	-		1.295	724	-	-	-	-	4	-
-	-		69	72	-	-	-	-	4	10
-	5		1.533	989	-	-	-	-	176	160
-	23		-	-	-	-	-	-	-	-
-	-		-	2	-	-	-	-	-	-
22	2.611		1.167.121	940.524	17	59	1	55	212.349	190.004
-	-		614	2.030	-	-	-	-	6	-
-	-		-	-	-	-	-	-	-	-
-	-		-	-	-	-	-	-	-	-
-	20		6	976	-	-	-	-	-	-
-	-		3.823	6.635	-	-	-	-	-	43
-	-		-	-	-	-	-	-	-	-
3	7		715	609	-	-	-	-	185	165
-	-		90	86	-	-	-	-	26	27
-	-		57	56	-	-	-	-	28	23
-	-		4.096	288	17	29	-	-	562	55
19	50		94	118	-	30	1	55	86	81
22	77		9.495	10.798	17	59	1	55	893	394
\$ -	\$ 2.534		\$ 1.157.626	\$ 929.726	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 211.456	\$ 189.610
FTGF ClearBridge Global Growth Fund ^α		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund ^α		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund ^α		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund ^{αη}		
Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	
\$ 185	\$ 385	€ 17.951	€ 25.979	\$ 24	\$ 50	\$ 10.286	\$ 8.169	\$ 506	\$ -	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
16.583	12.823	807.917	1.032.510	-	-	326.235	399.290	5144	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	26	1.921	-	-	255	24	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
95	-	450	3.932	-	-	294	3.321	3	-	
-	-	747	2.238	-	-	27	1.858	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	1	-	
9	13	1.466	1.740	-	-	2.107	2.085	9	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	6	-	
-	-	-	3	-	-	-	14	-	-	
16.872	13.221	828.557	1.068.323	24	50	339.204	414.761	5.669	-	
-	-	1	2	-	-	-	6	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	891	1.058	-	-	124	2.229	-	-	
52	-	450	2.286	-	-	5.843	3.872	3	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	6	655	826	-	-	296	377	-	-	
8	9	69	103	-	3	28	31	10	-	
-	-	76	99	-	-	51	74	-	-	
50	-	3.388	1.022	-	-	989	2.062	-	-	
41	27	104	94	24	47	64	62	15	-	
154	42	5.634	5.490	24	50	7.395	8.713	28	-	
\$ 16.718	\$ 13.179	€ 822.923	€ 1.062.833	\$ -	\$ -	\$ 331.809	\$ 406.048	\$ 5.641	\$ -	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]	
	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 1.913	\$ 1	\$ 12	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 23	\$ 23
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	330	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	689.142	744.113	96.082	78.654	4.422	4.273	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	292	150	1	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	3.223	1.897	294	144	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	6.008	711	64	1	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	13	–	1	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	406	474	34	16	7	8	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	11	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	1	–	–	–	–
Gesamtumlautvermögen	700.997	747.676	96.488	78.816	4.440	4.281	23	23
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	4	643	–	142	8	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	170	1.623	–	2	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	1.393	1.944	343	358	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	595	624	97	83	–	1	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	74	82	15	16	6	7	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	111	109	12	12	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.599	915	25	37	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	161	207	61	68	40	19	23	23
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	6.107	6.147	553	718	54	27	23	23
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 694.890	\$ 741.529	\$ 95.935	\$ 78.098	\$ 4.386	\$ 4.254	\$ –	\$ –
Legg Mason Japan Equity Fund[^]								
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^{^β}								
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^]								
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^]								
(in Tsd.)	Legg Mason Japan Equity Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund ^{^β}		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	
	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	¥ 126.058	¥ 114.974	\$ 57	\$ 12	\$ 28	\$ 28	€ 83	€ 65
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	–	–	–	3.598	–	–	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	–	14	–	–	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	4	–	–	–	–
Gesamtumlautvermögen	126.058	114.974	57	3.628	28	28	83	65
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	2	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	3	14	–	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	126.058	114.974	54	74	28	28	83	65
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	126.058	114.974	57	90	28	28	83	65
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	¥ –	¥ –	\$ –	\$ 3.538	\$ –	\$ –	€ –	€ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund ^{^δ}		Legg Mason Battery March International Large Cap Fund [^]		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	
Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
€ 1.417	€ 1.256	\$ 2.264	\$ 402	\$ 61	\$ 60	\$ 38	\$ 41	\$ 2.544	\$ 2.569
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	20.883	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	3	-	-	-	-	-	-
-	-	-	1	-	-	-	-	-	-
11	3	-	62	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.428	1.259	2.264	21.351	61	60	38	41	2.544	2.569
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	90	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	3	-	25	-	-	-	-	-	-
-	-	2	11	-	-	-	-	-	4
-	-	-	2	-	-	-	-	-	-
1.175	1.185	2.213	-	59	59	1	2	2.517	2.516
253	71	49	133	2	1	37	39	27	49
1.428	1.259	2.264	261	61	60	38	41	2.544	2.569
€ -	€ -	\$ -	\$ 21.090	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]		FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	
Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 61	\$ -	\$ 87	\$ 134	\$ 156	\$ -	\$ 174
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	123.913	142.529	21.066	24.963	31.826	34.547
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	385	41	-	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	63	154	518	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	107	104
-	-	-	-	82	85	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	70	61	131	145	27	31
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
51	51	61	61	124.513	142.957	21.849	25.265	31.960	34.856
-	-	-	-	180	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	22	1.422	-	19	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	63	154	507	-	75	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	64	76	8	18	16	26
-	-	-	-	16	19	8	9	10	11
-	-	-	-	7	8	-	3	-	1
51	51	38	38	89	184	5	-	40	-
-	-	23	23	51	45	177	95	172	116
51	51	61	61	492	1.908	705	144	313	154
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 124.021	\$ 141.049	\$ 21.144	\$ 25.121	\$ 31.647	\$ 34.702

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Improving Society Fund ^{^,γ}		Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	€ 930	€ 780	\$ 110	\$ –	€ 1.298	€ 1.848	\$ 216.937	\$ 331.948
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	67.581	312.657
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	186.811	188.780	6.124	–	85.524	34.759	15.732.630	17.052.700
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	69.548	1.742
Optionen	–	–	–	–	–	–	5.817	7.318
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	95.480	170.266
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	3	22	5	–	–	–	28.242	53.350
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	22.250	32.496
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	4.857	–	–	–	–	269.303	135.703
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	1.196	1.732	–	–	–	689	20.881	48.971
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	946	344	80.950	103.724
Dividendenforderungen	65	57	1	–	18	11	10.289	10.290
Verwaltungsgebühren	–	–	11	–	–	9	44	64
Sonstige Vermögenswerte	–	1	–	–	2	2	2	59
Gesamtumlaufvermögen	189.005	196.229	6.251	–	87.788	37.662	16.619.954	18.261.288
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	3	–	–	–	–	18.339	91.015
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	65.750	84.123
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	13.329	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	8.206	47.119
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	23.116	46.859
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	9	20	–	–	–	–	28.790	121.367
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	22.426	59.938
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	4.372	–	–	–	815	466.191	301.633
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	4.155	2.826
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	54	55	–	–	32	–	8.560	9.548
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	23	41	21	–	9	2	1.478	1.695
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1	1	–	–	–	–	910	1.005
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	2.603	–	–	–	–	48.290	54.803
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	40	37	44	–	43	22	10.107	11.327
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	127	7.132	65	–	84	839	719.647	833.258
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	€ 188.878	€ 189.097	\$ 6.186	\$ –	€ 87.704	€ 36.823	\$ 15.900.307	\$ 17.428.030

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR/0 JPY/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 JPY/1.000 GBP.

Die Euro-Beträge für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das am 29. Februar 2024 endende Geschäftsjahr zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,9252 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,9454).

Die Yen-Beträge für den Legg Mason Japan Equity Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das am 29. Februar 2024 endende Geschäftsjahr zum USD/JPY-Schlusskurs von 149,9200 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 136,1550).

Die Beträge in britischem Pfund für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das am 29. Februar 2024 endende Geschäftsjahr zum USD/GBP-Schlusskurs von 0,7922 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,8314).

α Mit Wirkung vom 24. März 2023 haben der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] den Handel eingestellt.

β Mit Wirkung vom 20. April 2023 hat der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] den Handel eingestellt.

γ Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 hat der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel aufgenommen.

δ Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 hat der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] den Handel eingestellt.

η Mit Wirkung vom 22. September 2023 hat der FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^] den Handel aufgenommen.

θ Mit Wirkung vom 23. Oktober 2023 hat der FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] den Handel eingestellt.

λ Mit Wirkung vom 6. November 2023 hat der FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^] den Handel aufgenommen.

μ Mit Wirkung vom 10. November 2023 hat der FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

¥ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2023 hat der FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Im Namen des Verwaltungsrats

Fionnuala Doris
Verwaltungsratsmitglied
13. Juni 2024

Joseph Keane
Verwaltungsratsmitglied

Bilanz – (Fortsetzung)

	29. Februar 2024			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil	Gesamt -NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^α									
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	€ 31	–	96,69	€ 26	–	80,63	€ 39	1	86,53
Klasse A EUR, thesaurierend	1.873	12	160,37	1.770	13	136,40	7.094	47	151,56
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	30	–	94,98	26	–	79,81	38	1	86,29
Klasse X EUR, thesaurierend	683	4	166,86	528	4	140,86	1.877	12	155,36
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	768	33	123,89	1.342	76	97,67	3.184	191	96,48
Klasse Premier EUR, thesaurierend	991	6	169,99	850	6	143,00	26.577	169	157,16
Klasse S USD, thesaurierend	1	–	132,29	1	–	108,31	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend	84.273	564	149,33	76.234	609	125,11	145.601	1.063	136,96
Klasse S GBP, thesaurierend	100.228	982	87,35	108.320	1.267	75,17	119.180	1.273	78,23
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^{α,γ}									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 97	1	97,47	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse X GBP, thesaurierend	1	–	113,48	–	–	–	–	–	–
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	851	7	99,05	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD, thesaurierend	4.640	47	98,72	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	96	1	97,23	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend	2	–	113,84	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	499	4	98,16	–	–	–	–	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund^α									
Klasse A EUR, thesaurierend	€ 10.087	97	104,08	€ 98	1	98,13	€ –	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	44.990	432	104,14	5.022	51	98,18	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus	–	–	–	98	1	98,13	–	–	–
Klasse D EUR, thesaurierend	1.157	11	103,46	98	1	98,08	–	–	–
Klasse D EUR, ausschüttend (A)	210	2	103,45	98	1	98,08	–	–	–
Klasse K EUR, thesaurierend	–	–	–	98	1	98,11	–	–	–
Klasse K EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	98	1	98,11	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend	491	5	104,52	9.474	97	98,17	–	–	–
Klasse X EUR, ausschüttend (A)	30.769	294	104,60	21.739	221	98,22	–	–	–

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 GBP.

Der NIW pro Anteil beinhaltet rückkaufbare gewinnberechtignte Anteile, die auf die jeweilige Währung jeder relevanten Anteilsklasse lauten.

α Mit Wirkung vom 24. März 2023 haben der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α und FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α den Handel eingestellt.

β Mit Wirkung vom 20. April 2023 hat der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^α den Handel eingestellt.

γ Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 hat der FTGF Martin Currie Improving Society Fund^α den Handel aufgenommen.

δ Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 hat der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^α den Handel eingestellt.

η Mit Wirkung vom 22. September 2023 hat der FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^α den Handel aufgenommen.

θ Mit Wirkung vom 23. Oktober 2023 hat der FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^α den Handel eingestellt.

λ Mit Wirkung vom 6. November 2023 hat der FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^α den Handel aufgenommen.

μ Mit Wirkung vom 10. November 2023 hat der FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^α den Handel eingestellt.

¥ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2023 hat der FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^α den Handel eingestellt.

α In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Gesamtergebnisrechnung

(in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 51.509	\$ 19.590	\$ 7.578	\$ 5.896	\$ 47.157	\$ 49.800	€ 2.261	€ 2.399
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	1	–	36	6	14	1
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	-1	-1	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	2	–	-2.958	-23.862	-103.623	-121.262	-12.108	-6.318
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	1.756	-6.884	96.548	-109.818	16.188	-18.592
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	51.511	19.590	6.377	-24.850	40.117	-181.275	6.355	-22.510
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	5.621	4.894	1.152	1.200	5.500	7.092	35	35
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	254	223	139	129	761	944	77	103
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	113	149	269	309	2	2
Rechtskosten	28	3	5	5	36	38	4	3
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	23	17	46	35	46	35	28	24
Druckkosten	10	54	–	15	–	87	5	9
Zinsaufwendungen	–	–	1	–	27	12	–	7
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	11	7	2	1	13	10	2	1
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	126	85	38	148	191	520	40	29
Aufwendungen gesamt	6.073	5.283	1.496	1.682	6.843	9.047	193	213
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	-645	-64	-51	-3	-15	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	6.073	4.638	1.432	1.631	6.840	9.032	193	213
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	45.438	14.952	4.945	-26.481	33.277	-190.307	6.162	-22.723
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-36.140	-11.932	-1.973	-1.859	-2.990	-2.917	-18	-8
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	9.298	3.020	2.972	-28.340	30.287	-193.224	6.144	-22.731
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	-2	4	-86	-236	5	2
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 9.298	\$ 3.020	\$ 2.970	\$ -28.336	\$ 30.201	\$ -193.460	€ 6.149	€ -22.729

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund [^]		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 3.691	\$ 4.211	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.736
Zinsen (Erläuterung 2)	2	1	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	-1	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-7.210	-4.968	–	–	–	–	–	-3.715
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	7.415	-6.290	–	–	–	–	–	-1.106
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	3.897	-7.046	–	–	–	–	–	-3.085
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	468	604	–	–	–	–	–	76
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	46	52	–	–	–	–	–	18
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	65	80	–	–	–	–	–	10
Rechtskosten	2	1	–	–	–	–	–	1
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	30	22	–	–	–	–	–	13
Druckkosten	3	6	–	–	–	–	–	4
Zinsaufwendungen	–	1	–	–	–	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	1	–	–	–	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	57	43	–	–	–	–	–	35
Aufwendungen gesamt	672	809	–	–	–	–	–	157
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-43	-21	–	–	–	–	–	-32
Gesamtnettoaufwendungen	629	788	–	–	–	–	–	125
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	3.268	-7.834	–	–	–	–	–	-3.210
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-2.600	-2.507	–	–	–	–	–	-153
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	668	-10.341	–	–	–	–	–	3.363
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	10	-40	–	–	–	–	–	2
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 678	\$ -10.381	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -3.361

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
\$ -	\$ 2.290	\$ 13.206	\$ 12.184	\$ 8.798	\$ 12.690	\$ -	\$ 1.115	\$ -	\$ 357
-	-	14	3	-	-	-	-	-	-
-	-	7	-1	1	-	-	-	-	-
18	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-5.513	-21.878	-18.028	-9.725	-26.636	-	-9.246	-1	-5.081
-	1.341	23.817	-29.851	10.243	-8.685	-	4.275	1	2.932
18	-1.882	15.166	-35.693	9.317	-22.631	-	-3.856	-	-1.792
-	418	1.139	1.174	755	1.053	-	121	-	2
-	34	179	175	89	132	-	20	-	7
-	46	74	79	85	103	-	8	-	-
-	1	7	7	4	6	-	-	-	-
-	11	46	35	30	22	-	12	-	10
-	4	-	19	-	14	-	3	-	1
-	-	3	3	1	3	-	-	-	-
-	-	3	1	1	1	-	-	-	-
18	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	27	72	80	41	72	-	25	-	10
18	541	1.523	1.573	1.006	1.406	-	189	-	30
-	-24	-4	-1	-7	-10	-	-14	-	-17
18	517	1.519	1.572	999	1.396	-	175	-	13
-	-2.399	13.647	-37.265	8.318	-24.027	-	-4.031	-	-1.805
-	-533	-5.048	-4.900	-4.062	-3.795	-	-826	-	-319
-	-2.932	8.599	-42.165	4.256	-27.822	-	-4.857	-	-2.124
-	-1	-129	-183	5	-77	-	1	-	10
\$ -	\$ -2.933	\$ 8.470	\$ -42.348	\$ 4.261	\$ -27.899	\$ -	\$ -4.856	\$ -	\$ -2.114
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
\$ 17.114	\$ 18.250	\$ 13.849	\$ 6.684	\$ 5.375	\$ 4.665	\$ 1.345	\$ 1.973	€ -	€ 404
2	4	23	2	6	1	2	-	-	-
-1.227	-6	-2	13	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-39.035	-11.414	-7.417	-14.415	-7.922	-18.099	-4.996	-4.202	-	-3.794
36.019	-45.874	34.383	-41.738	10.643	-13.755	5.288	-6.019	-	992
12.873	39.040	40.836	-49.454	8.102	-27.188	1.639	-8.248	-	-2.398
2.796	3.084	1.904	1.557	239	239	20	23	-	-
308	321	379	290	117	118	33	49	-	8
161	187	160	107	2	3	3	4	-	-
14	12	16	12	5	4	2	1	-	-
46	35	31	23	31	23	31	23	-	12
1	30	22	27	7	13	2	5	-	2
1	1	5	6	1	2	-	1	-	14
5	4	6	3	2	1	-	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
105	122	132	77	91	60	34	21	-	2
3.437	3.796	2.655	2.102	495	463	125	128	-	38
-	-	-2	-	-10	-	-	-	-	-11
3.437	3.796	2.653	2.102	485	463	125	128	-	27
9.436	-42.836	38.183	-51.556	7.617	-27.651	1.514	-8.376	-	-2.425
6.491	-6.139	-9.370	-3.697	-	-	-	-	-	-1
2.945	-48.975	28.813	-55.253	7.617	-27.651	1.514	-8.376	-	-2.426
-442	-449	22	-4	-49	-34	-1	-3	-	-
\$ 2.503	\$ 49.424	\$ 28.835	\$ -55.257	\$ 7.568	\$ -27.685	\$ 1.513	\$ -8.379	€ -	€ -2.426

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi- Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 100.114	\$ 119.538	\$ –	\$ –	\$ 24.593	\$ 17.639	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	53	193	–	–	6	1	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	-523	366	–	–	–	14	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-187.391	-808.592	–	–	-11.557	-67.965	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	235.632	213.028	–	–	20.147	-7.496	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	147.885	-475.467	–	–	33.189	-57.807	–	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	19.179	30.787	–	–	320	310	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	1.170	1.815	–	–	239	205	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1.444	2.121	–	–	–	–	–	–
Rechtskosten	28	90	–	–	9	14	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	46	35	–	–	31	24	–	–
Druckkosten	–	213	–	–	16	38	–	–
Zinsaufwendungen	32	112	–	–	–	4	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	20	23	–	–	3	2	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	58	536	–	–	78	92	–	–
Aufwendungen gesamt	21.977	35.732	–	–	696	689	–	–
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	-1	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	21.977	35.732	–	–	696	688	–	–
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	125.908	-511.199	–	–	32.493	-58.495	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-22.344	-18.470	–	–	-1.343	-309	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	103.564	-529.669	–	–	31.150	-58.804	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-4.103	-5.966	–	–	-71	-110	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 99.461	\$ -535.635	\$ –	\$ –	\$ 31.079	\$ -58.914	\$ –	\$ –

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 221	\$ 245	\$ 9.475	\$ 8.345	\$ 21.603	\$ 25.709	\$ 2.106	\$ 794
Zinsen (Erläuterung 2)	1	–	1	1	1	2	1	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	-60	-39	–	–	7	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-1.504	447	-31.189	-33.243	-29.812	-104.216	248	-2.007
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	1.690	-1.476	26.431	-8.855	24.190	-9.919	999	40
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	408	-784	4.658	-33.791	15.982	-88.424	3.361	-1.173
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	21	28	985	1.242	2.363	2.452	97	47
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	17	19	127	143	258	427	24	13
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	129	177	7	8	2	–
Rechtskosten	8	5	4	4	15	15	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	14	16	46	35	31	23	31	23
Druckkosten	–	1	–	1	–	41	1	2
Zinsaufwendungen	–	–	1	3	2	25	1	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	2	1	5	5	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	25	22	67	20	99	112	41	13
Aufwendungen gesamt	85	91	1.361	1.626	2.780	3.108	197	98
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-53	-50	–	–	–	–	-59	-36
Gesamtnettoaufwendungen	32	41	1.361	1.626	2.780	3.108	138	62
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	376	-825	3.297	-35.417	13.202	-91.532	3.223	-1.235
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	-1.877	-1.003	-1.543	-877	-22	-6
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	376	-825	1.420	-36.420	11.659	-92.409	3.201	-1.241
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	-85	372	-980	-520	–	-2
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 376	\$ -825	\$ 1.335	\$ -36.048	\$ 10.679	\$ -92.929	\$ 3.201	\$ -1.243

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund ^u		Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
\$ 39.224	\$ 37.779	\$ 40.198	\$ 32.881	£ 1.027	£ 1.738	\$ 2.674	\$ 5.142	\$ 787	\$ 629
1	1	7	-	13	2	3	1	-	-
12	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-18.167	-25.905	-28.926	-47.722	-8.874	-6.233	-14.154	-41.235	-585	-3.160
13.059	-63.132	17.340	-96.912	7.173	-6.171	11.748	-4.223	380	-792
34.129	-51.257	28.619	-111.753	-661	-10.664	271	-40.315	582	-3.323
700	1.351	179	97	-	-	30	61	-	-
408	475	864	780	24	46	45	95	19	19
10	28	-	-	-	-	-	1	-	-
66	35	35	29	1	2	2	4	1	1
46	35	30	23	9	15	16	23	24	23
-	57	50	61	1	4	3	10	1	1
1	2	8	1	-	-	1	1	-	-
6	6	13	8	-	1	1	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
50	130	167	144	10	15	31	33	21	32
1.287	2.119	1.346	1.143	45	83	129	229	66	76
-	-	-	-	-	-	-9	-	-66	-76
1.287	2.119	1.346	1.143	45	83	120	229	-	-
32.842	-53.376	27.273	-112.896	-706	-10.747	151	-40.544	582	-3.323
-962	-945	-	-	-1.026	-757	-2.350	-2.031	-949	-686
31.880	-54.321	27.273	-112.896	-1.732	-11.504	-2.199	-42.575	-367	-4.009
17	-	-	-	5	1	-4	-53	-3	-2
\$ 31.897	\$ -54.321	\$ 27.273	\$ -112.896	£ -1.727	£ -11.503	\$ -2.203	\$ -42.628	\$ -370	\$ -4.011
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
\$ 12.627	\$ 8.940	\$ -	\$ -	\$ 75.076	\$ 55.299	\$ 2.327	\$ 2.445	\$ 50	\$ 613
1	-	-	-	4	9	4	1	-	-
-	-	-	-	27	18	-	-	-	-
-	-	-	1.930	-	-	-	-	-	-
-31.650	-30.719	-	-	-109.856	-176.578	-3.447	-1.815	-420	-1.880
26.247	-13.662	-	-	118.577	-69.518	1.357	-433	452	128
7.225	-35.441	-	1.930	83.828	-190.770	241	198	82	-1.139
1.318	1.293	-	-	8.827	9.957	330	592	2	34
166	162	-	-	909	917	32	52	1	11
10	8	-	-	966	1.089	5	18	-	-
6	6	-	-	39	43	2	1	-	-
31	22	-	-	46	49	31	23	-	34
10	15	-	-	52	80	2	4	-	2
-	3	-	-	6	14	4	1	-	-
2	1	-	-	15	13	-	-	-	-
-	-	-	1.930	-	-	-	-	-	-
71	26	-	-	347	312	49	26	-	30
1.614	1.536	-	1.930	11.207	12.474	455	717	3	111
-	-	-	-	-	-	-72	-33	-	-65
1.614	1.536	-	1.930	11.207	12.474	383	684	3	46
5.611	-36.977	-	-	72.621	-203.244	-142	-486	79	-1.185
-186	-121	-	-	-31.359	-24.709	-	-	-576	-588
5.425	-37.098	-	-	41.262	-227.953	-142	-486	-497	-1.773
-132	-162	-	-	-871	-847	-6	17	-	-2
\$ 5.293	\$ -37.260	\$ -	\$ -	\$ 40.391	\$ -228.800	\$ -148	\$ -469	\$ -497	\$ -1.775

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ –	\$ –	\$ 5.130	\$ 4.421	\$ 1.062	\$ 226	\$ 536	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	-11.759	-19.601	-499	-254	877	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	8.515	-1.726	550	-139	426	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	–	–	1.886	-16.906	1.113	-167	1.839	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	2	3	55	17	21	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	59	59	17	6	10	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Rechtskosten	–	–	2	2	1	–	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	31	23	21	16	19	–
Druckkosten	–	–	3	8	1	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	1	1	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	36	38	45	15	7	–
Aufwendungen gesamt	–	–	134	134	140	54	57	–
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	-27	-24	-70	-32	-20	–
Gesamtnettoaufwendungen	–	–	107	110	70	22	37	–
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	–	–	1.779	-17.016	1.043	-189	1.802	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	–	–	-14	-2	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	–	–	1.779	-17.016	1.029	-191	1.802	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	-152	-186	-13	-9	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ 1.627	\$ -17.202	\$ 1.016	\$ -200	\$ 1.802	\$ –

(in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 11.107	\$ 10.386	\$ 2.178	\$ 4.300	\$ 1.207	\$ 1.556	\$ 21.822	\$ 19.216
Zinsen (Erläuterung 2)	1	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	-7	-12	-1	–	-97	-2
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	60.195	119.361	18.539	38.275	4.239	-49	-28.473	-40.931
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	558.734	-379.934	27.833	-119.909	641	-4.889	242.843	-118.836
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	630.037	-250.187	48.543	-77.346	6.086	-3.382	236.095	-140.553
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	12.450	10.827	2.430	3.723	409	464	8.141	8.276
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	1.212	998	179	280	35	37	1.194	1.111
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1.614	1.464	436	502	65	76	1.906	1.780
Rechtskosten	43	42	7	9	2	1	51	43
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	46	35	46	35	31	23	31	30
Druckkosten	–	100	14	–	2	3	77	81
Zinsaufwendungen	1	1	3	–	–	–	38	10
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	16	10	2	3	–	–	20	13
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	217	315	59	58	61	35	381	250
Aufwendungen gesamt	15.599	13.792	3.176	4.610	605	639	11.839	11.594
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	-2	–	-79	-40	-96	-89
Gesamtnettoaufwendungen	15.599	13.792	3.174	4.610	526	599	11.743	11.505
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	614.438	-263.979	45.369	-81.956	5.560	-3.981	224.352	-152.058
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	-57	–	-148	-226	-130	-86
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	614.438	-263.979	45.312	-81.956	5.412	-4.207	224.222	-152.144
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-2.863	-2.801	-431	-851	-298	-370	-5.738	-5.143
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 611.575	\$ -266.780	\$ 44.881	\$ -82.807	\$ 5.114	\$ -4.577	\$ 218.484	\$ -157.287

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^α		FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund ^Δ		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund ^Δ		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
\$ 7	\$ 52	\$ 20.597	\$ 18.832	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 3.336	\$ 3.244
-	-	1	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-16	-37	-	-	-	-	-2	-1
-	-	-	-	-	-	4	-	-	-
-109	79	30.591	27.825	-	-	-	-	21.869	10.875
-63	-213	100.238	-53.148	-	-	-	-	29.885	-27.103
-165	-82	151.411	-6.528	-	-	4	-	55.088	-12.985
1	12	7.868	7.465	-	-	-	-	2.202	2.177
-	7	763	655	-	-	-	-	164	146
-	1	677	689	-	-	-	-	349	359
-	-	29	23	-	-	-	-	6	5
-	34	23	17	-	-	-	-	31	23
-	-	39	46	-	-	-	-	9	13
-	-	6	-	-	-	-	-	-	-
-	-	11	6	-	-	-	-	2	1
-	-	-	-	-	-	4	-	-	-
-	20	205	169	-	-	-	-	86	104
1	74	9.621	9.070	-	-	4	-	2.849	2.828
-	-58	-	-	-	-	-	-	-7	-15
1	16	9.621	9.070	-	-	4	-	2.842	2.813
-166	-98	141.790	-15.598	-	-	-	-	52.246	-15.798
-	-	-153	-136	-	-	-	-	-14	-6
-166	-98	141.637	-15.734	-	-	-	-	52.232	-15.804
-2	-14	-5.445	-5.023	-	-	-	-	-940	-921
\$ -168	\$ -112	\$ 136.192	\$ -20.757	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 51.292	\$ -16.725
FTGF ClearBridge Global Growth Fund ^Δ		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund ^Δ		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund ^Δ		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund ^Δ	
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
\$ 174	\$ 181	€ 30.153	€ 24.238	\$ -	\$ 73	\$ 21.485	\$ 16.804	\$ 46	\$ -
-	-	139	15	-	-	-	-	1	-
-	-	-138	-147	-	-	-22	-18	-	-
-	-	-	-	2	-	-	-	-	-
362	-164	-10.859	97.667	-	-446	-29.689	-20.310	-64	-
3.143	-1.038	24.626	-99.004	-	12	14.685	-33.358	676	-
3.679	-1.021	43.921	22.769	2	-361	6.459	-36.882	659	-
100	89	9.203	10.180	-	19	4.266	4.260	7	-
17	15	744	739	-	3	293	255	4	-
3	2	1.104	1.277	-	3	774	885	-	-
-	-	32	25	-	-	17	7	-	-
15	11	27	24	-	10	18	16	12	-
1	1	45	45	-	-	24	11	-	-
-	-	-	164	-	-	-	1	1	-
-	-	13	7	-	-	5	2	-	-
-	-	-	-	2	-	-	-	-	-
31	19	231	140	-	30	121	79	17	-
167	137	11.399	12.601	2	65	5.518	5.516	41	-
-43	-26	-	-	-	-40	-2	-	-30	-
124	111	11.399	12.601	2	25	5.516	5.516	11	-
3.555	-1.132	32.522	10.168	-	-386	943	-42.398	648	-
-	-	-6.882	-6.157	-	-16	-15.910	-14.505	-	-
3.555	-1.132	25.640	4.011	-	-402	-14.967	-56.903	648	-
-28	-30	-4.291	-4.301	-	-	-2.583	-2.061	-7	-
\$ 3.527	\$ -1.162	€ 21.349	€ -290	\$ -	\$ -402	\$ -17.550	\$ -58.964	\$ 641	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 8.146	\$ 9.694	\$ 1.254	\$ 1.009	\$ 75	\$ 71	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	1	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	-2	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	10.605	-26.757	2.336	3.014	-263	-330	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	33.108	-23.159	6.549	-2.696	377	14	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	51.860	-40.222	10.137	1.327	189	-245	–	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	7.093	7.773	1.120	1.052	31	31	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	529	538	74	64	9	8	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1.257	1.310	175	174	–	–	–	–
Rechtskosten	21	20	3	3	–	2	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	46	35	31	23	16	10	–	–
Druckkosten	–	56	4	6	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	1	–	–	–	–	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	8	5	1	–	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	187	178	49	43	53	14	–	–
Aufwendungen gesamt	9.142	9.915	1.457	1.365	109	65	–	–
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	-16	-11	-72	-28	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	9.142	9.915	1.441	1.354	37	37	–	–
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	42.718	-50.137	8.696	-27	152	-282	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	-8	–	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	42.718	-50.137	8.688	-27	152	-282	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-1.729	-1.694	-303	-238	-12	-12	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 40.989	\$ -51.831	\$ 8.385	\$ -265	\$ 140	\$ -294	\$ –	\$ –

(in Tsd.)	Legg Mason Japan Equity Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund ^{^β}		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	¥ –	¥ –	\$ 4	\$ 347	\$ –	\$ –	€ –	€ –
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	-1	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	22	–
Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	-414	-1.890	–	–	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	565	717	–	–	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	–	–	155	-827	–	–	22	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	4	96	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	1	17	–	–	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	1	8	–	–	–	–
Rechtskosten	–	–	–	1	–	–	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	6	11	–	–	–	–
Druckkosten	–	–	–	4	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	22	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	11	21	–	–	–	–
Aufwendungen gesamt	–	–	23	158	–	–	22	–
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	-17	-43	–	–	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	–	–	6	115	–	–	22	–
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	–	–	149	-942	–	–	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	-23	-12	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	–	–	126	-954	–	–	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	1	-26	–	–	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	¥ –	¥ –	\$ 127	\$ -980	\$ –	\$ –	€ –	€ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund ^{^δ}		Legg Mason Battery March International Large Cap Fund [^]		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
€ -	€ 793	\$ 750	\$ 1.344	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 95
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-11	-	-	-	-	-	-
205	-	-	-	2	-	-	-	12	-
1	-726	-2.395	-825	-	-	-30	-	-	1.626
-1	-522	2.918	-2.521	-	-	30	-	-	-1.497
205	-455	1.273	-2.013	2	-	-	-	12	224
-	125	115	321	-	-	-	-	-	24
-	8	6	22	-	-	-	-	-	2
-	12	17	50	-	-	-	-	-	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	12	10	17	-	-	-	-	-	13
-	-	-	3	-	-	-	-	-	-
-	2	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
205	-	-	-	2	-	-	-	12	-
-	-	34	36	-	-	-	-	-	19
205	159	182	449	2	-	-	-	12	60
-	-9	-41	-31	-	-	-	-	-	-33
205	150	141	418	2	-	-	-	12	27
-	-605	1.132	-2.431	-	-	-	-	-	197
-	-120	-324	-523	-	-	-	-	-	-12
-	-725	808	-2.954	-	-	-	-	-	185
-	-206	4	-137	-	-	-	-	-	-19
€ -	€ -931	\$ 812	\$ -3.091	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 166
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]		FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 1.447	\$ 1.449	\$ 1.328	\$ 1.445	\$ 703	\$ 749
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-16.931	-28.509	-175	372	-1.652	-2.480
-	-	-	-	40.823	-7.103	-290	-3.071	2.019	-6.311
-	-	-	-	25.339	-34.163	863	-1.254	1.070	-8.042
-	-	-	-	930	994	195	237	337	368
-	-	-	-	114	109	23	24	33	34
-	-	-	-	110	110	60	72	16	18
-	-	-	-	5	4	1	1	1	1
-	-	-	-	23	17	23	17	15	11
-	-	-	-	6	9	1	2	2	4
-	-	-	-	1	1	-	-	1	-
-	-	-	-	2	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	63	40	49	34	57	46
-	-	-	-	1.254	1.285	352	387	462	482
-	-	-	-	-27	-	-65	-40	-59	-41
-	-	-	-	1.227	1.285	287	347	403	441
-	-	-	-	24.112	-35.448	576	-1.601	667	-8.483
-	-	-	-	-	-	-402	-452	-	-
-	-	-	-	24.112	-35.448	174	-2.053	667	-8.483
-	-	-	-	-99	-113	-230	-114	-81	-80
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 24.013	\$ -35.561	\$ -56	\$ -2.167	\$ 586	\$ -8.563

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund ^α		FTGF Martin Currie Improving Society Fund ^{α,γ}		Franklin Responsible Income 2028 Fund ^α		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	€ 2.344	€ 3.040	\$ 32	\$ –	€ 3.591	€ 122	\$ 645.956	\$ 587.213
Zinsen (Erläuterung 2)	7	–	–	–	6	–	369	245
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	-2.057	129
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	284	1.930
Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-6.961	-22.697	-2	–	-287	-16	-659.861	-1.491.020
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	37.661	-7.891	-3	–	2.192	-738	1.894.830	-1.248.346
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	33.051	-27.548	27	–	5.502	-632	1.879.521	-2.149.849
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	682	857	4	–	358	7	112.861	129.714
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	158	178	7	–	65	3	12.488	13.176
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	8	15	2	–	–	–	12.174	13.404
Rechtskosten	6	7	–	–	2	–	572	541
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	21	24	13	–	19	16	1.404	1.266
Druckkosten	8	15	–	–	3	–	430	1.234
Zinsaufwendungen	–	7	–	–	–	–	147	410
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	2	2	–	–	–	–	198	143
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	284	1.930
Sonstige Aufwendungen	39	43	61	–	35	6	4.207	4.664
Aufwendungen gesamt	924	1.148	87	–	482	32	144.765	166.482
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-2	-11	-76	–	-10	-20	-1.154	-1.695
Gesamtnettoaufwendungen	922	1.137	11	–	472	12	143.611	164.787
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	32.129	-28.685	16	–	5.030	-644	1.735.910	-2.314.636
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	–	–	–	–	-158.128	-112.586
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	32.129	-28.685	16	–	5.030	-644	1.577.782	-2.427.222
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-168	-266	-4	–	-20	–	-32.704	-33.107
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 31.961	€ -28.951	\$ 12	\$ –	€ 5.010	€ -644	\$ 1.545.078	\$ -2.460.329

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR/0 JPY/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 JPY/1.000 GBP.

Gewinne und Verluste haben sich ausschließlich aus dem laufenden Geschäftsbetrieb ergeben, außer beim FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^α, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^α, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^α, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^α und FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^α. Es gab keine sonstigen Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die Euro-Beträge für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^α, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^α, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^α, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^α, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^α und Franklin Responsible Income 2028 Fund^α wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das am 29. Februar 2024 endende Geschäftsjahr mit einem durchschnittlichen USD/EUR-Kurs von 0,9232 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,9590).

Die Beträge in britischem Pfund für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^α wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das am 29. Februar 2024 endende Geschäftsjahr zum durchschnittlichen USD/GBP-Wechselkurs von 0,7988 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,8252).

α Mit Wirkung vom 24. März 2023 haben der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α und FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α den Handel eingestellt.

β Mit Wirkung vom 20. April 2023 hat der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^α den Handel eingestellt.

γ Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 hat der FTGF Martin Currie Improving Society Fund^α den Handel aufgenommen.

δ Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 hat der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^α den Handel eingestellt.

η Mit Wirkung vom 22. September 2023 hat der FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^α den Handel aufgenommen.

θ Mit Wirkung vom 23. Oktober 2023 hat der FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^α den Handel eingestellt.

λ Mit Wirkung vom 6. November 2023 hat der FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^α den Handel aufgenommen.

μ Mit Wirkung vom 10. November 2023 hat der FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^α den Handel eingestellt.

¥ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2023 hat der FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^α den Handel eingestellt.

α In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens

(in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 9.298	\$ 3.020	\$ 2.970	\$ -28.336	\$ 30.201	\$ -193.460	€ 6.149	€ -22.729
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	2.012.301	1.682.979	105.441	38.164	258.516	631.688	1.802	8.626
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	34.623	9.839	1.254	941	1.082	943	8	4
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-1.775.419	-1.781.547	-56.124	-111.756	-623.244	-778.561	-90.597	-2.820
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	271.505	-88.729	50.571	-72.651	-363.646	-145.930	-88.787	5.810
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	280.803	-85.709	53.541	-100.987	-333.445	-339.390	-82.638	-16.919
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	833.615	919.324	131.919	232.906	1.148.700	1.488.090	132.467	149.386
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 1.114.418	\$ 833.615	\$ 185.460	\$ 131.919	\$ 815.255	\$ 1.148.700	€ 49.829	€ 132.467

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund [^]		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 678	\$ -10.381	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -3.361
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	4.202	7.829	-	-	-	-	-	6.133
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	272	235	-	-	-	-	-	45
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-14.064	-22.230	-	-	-	-	-	-62.342
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-9.590	-14.166	-	-	-	-	-	-56.164
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-8.912	-24.547	-	-	-	-	-	-59.525
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	57.431	81.978	-	-	-	-	-	59.525
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 48.519	\$ 57.431	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 99.461	\$ -535.635	\$ -	\$ -	\$ 31.079	\$ -58.914	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	367.209	594.445	-	-	104.145	97.245	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	752	572	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-1.394.954	-2.110.715	-	-	-37.555	-135.218	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-1.026.993	-1.515.698	-	-	66.590	-37.973	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-927.532	-2.051.333	-	-	97.669	-96.887	-	-
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	2.132.501	4.183.834	-	-	275.012	371.899	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 1.204.969	\$ 2.132.501	\$ -	\$ -	\$ 372.681	\$ 275.012	\$ -	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
\$ -	\$ -2.933	\$ 8.470	\$ -42.348	\$ 4.261	\$ -27.899	\$ -	\$ -4.856	\$ -	\$ -2.114
-	5.974	35.895	116.601	14.197	80.773	-	9.398	-	1
-	336	542	524	2.702	2.460	-	790	-	319
-	-56.369	-31.322	-150.391	-49.522	-189.194	-	-46.450	-	-26.054
-	-50.059	5.115	-33.266	-32.623	-105.961	-	-36.262	-	-25.734
-	-52.992	13.585	-75.614	-28.362	-133.860	-	-41.118	-	-27.848
-	52.992	227.355	302.969	125.240	259.100	-	41.118	-	27.848
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ -	\$ -	\$ 240.940	\$ 227.355	\$ 96.878	\$ 125.240	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
\$ 2.503	\$ -49.424	\$ 28.835	\$ -55.257	\$ 7.568	\$ -27.685	\$ 1.513	\$ -8.379	€ -	€ -2.426
61.423	59.409	270.177	309.635	39.375	20.632	562	669	-	4
115	101	43	18	-	-	-	-	-	-
-251.120	-82.173	-344.487	-174.675	-64.226	-49.192	-17.128	-23.593	-	-35.026
-189.582	-22.663	-74.267	134.978	-24.851	-28.560	-16.566	-22.924	-	-35.022
-187.079	-72.087	-45.432	79.721	-17.283	-56.245	-15.053	-31.303	-	-37.448
437.707	509.794	523.970	444.249	146.703	202.948	46.050	77.353	-	37.448
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 250.628	\$ 437.707	\$ 478.538	\$ 523.970	\$ 129.420	\$ 146.703	\$ 30.997	\$ 46.050	€ -	€ -
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
\$ 31.897	\$ -54.321	\$ 27.273	\$ -112.896	£ -1.727	£ -11.503	\$ -2.203	\$ -42.628	\$ -370	\$ -4.011
4.387	10.281	2.928	87.515	-	69.541	41	134.961	183	330
-	-	-	-	-	396	-	-	685	655
-69.676	-454.353	-	-2.392	-44.185	-86.155	-92.613	-172.727	-543	-491
-65.289	-444.072	2.928	85.123	-44.185	-16.218	-92.572	-37.766	325	494
-33.392	-498.393	30.201	-27.773	-45.912	-27.721	-94.775	-80.394	-45	-3.517
559.548	1.057.941	1.119.507	1.147.280	45.912	73.633	94.775	175.169	18.441	21.958
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 526.156	\$ 559.548	\$ 1.149.708	\$ 1.119.507	£ -	£ 45.912	\$ -	\$ 94.775	\$ 18.396	\$ 18.441

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Bond Fund [^] ¥		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 376	\$ -825	\$ 1.335	\$ -36.048	\$ 10.679	\$ -92.929	\$ 3.201	\$ -1.243
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	21.189	60.682	50.459	236.790	24.952	67
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	617	270	9	5	3	1
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-9.371	-46	-40.065	-78.530	-454.149	-357.313	-7.386	-21
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-9.371	-46	-18.259	-17.578	-403.681	-120.518	17.569	47
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-8.995	-871	-16.924	-53.626	-393.002	-213.447	20.770	-1.196
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	8.995	9.866	162.009	215.635	539.271	752.718	10.394	11.590
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ -	\$ 8.995	\$ 145.085	\$ 162.009	\$ 146.269	\$ 539.271	\$ 31.164	\$ 10.394

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	\$ 1.627	\$ -17.202	\$ 1.016	\$ -200	\$ 1.802	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	-	112	5	15.028	32.000	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	4	1	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-	-17.731	-	-25	-2.103	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-17.619	9	15.004	29.897	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	1.627	-34.821	1.025	14.804	31.699	-
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	-	-	69.410	104.231	14.804	-	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ -	\$ -	\$ 71.037	\$ 69.410	\$ 15.829	\$ 14.804	\$ 31.699	\$ -

(in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 611.575	\$ -266.780	\$ 44.881	\$ -82.807	\$ 5.114	\$ -4.577	\$ 218.484	\$ -157.287
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	682.765	375.752	14.386	21.160	945	5.178	524.057	954.316
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	7	4	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-647.475	-655.932	-76.670	-251.719	-8.658	-5.356	-1.017.010	-756.365
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	35.290	-280.180	-62.284	-230.559	-7.706	-174	-492.953	197.951
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	646.865	-546.960	-17.403	-313.366	-2.592	-4.751	-274.469	40.664
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	1.225.735	1.772.695	224.793	538.159	38.528	43.279	1.639.979	1.599.315
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 1.872.600	\$ 1.225.735	\$ 207.390	\$ 224.793	\$ 35.936	\$ 38.528	\$ 1.365.510	\$ 1.639.979

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund ^{^α}	
für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
\$ 5.293	\$ -37.260	\$ -	\$ -	\$ 40.391	\$ -228.800	\$ -148	\$ -469	\$ -497	\$ -1.775
39.013	8.297	-	-	265.947	382.317	3.404	1.851	-	-
16	9	-	-	500	353	-	-	-	1
-42.092	-10.296	-	-	-365.763	-551.638	-33.609	-7.012	-7.892	-
-3.063	-1.990	-	-	-99.316	-168.968	-30.205	-5.161	-7.892	1
2.230	-39.250	-	-	-58.925	-397.768	-30.353	-5.630	-8.389	-1.774
205.146	244.396	-	-	1.210.305	1.608.073	46.756	52.386	8.389	10.163
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 207.376	\$ 205.146	\$ -	\$ -	\$ 1.151.380	\$ 1.210.305	\$ 16.403	\$ 46.756	\$ -	\$ 8.389
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^{^α}		FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
\$ -168	\$ -112	\$ 136.192	\$ -20.757	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 51.292	\$ -16.725
-	480	472.996	283.185	-	-	-	-	31.681	27.366
-	-	1	4	-	-	-	-	3	-
-2.366	-11	-381.289	-224.944	-	-	-	-	-61.130	-34.511
-2.366	469	91.708	58.245	-	-	-	-	-29.446	-7.145
-2.534	357	227.900	37.488	-	-	-	-	21.846	-23.870
2.534	2.177	929.726	892.238	-	-	-	-	189.610	213.480
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ -	\$ 2.534	\$ 1.157.626	\$ 929.726	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 211.456	\$ 189.610
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund ^{^η}	
für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
\$ 3.527	\$ -1.162	€ 21.349	€ -290	\$ -	\$ -402	\$ -17.550	\$ -58.964	\$ 641	\$ -
1.002	211	391.958	933.315	-	19	64.682	446.097	5.000	-
-	-	25	24	-	3	2.357	1.541	-	-
-990	-1.888	-653.242	-541.640	-	-2.285	-123.728	-156.020	-	-
12	-1.677	-261.259	391.699	-	-2.263	-56.689	291.618	5.000	-
3.539	-2.839	-239.910	391.409	-	-2.665	-74.239	232.654	5.641	-
13.179	16.018	1.062.833	671.424	-	2.665	406.048	173.394	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 16.718	\$ 13.179	€ 822.923	€ 1.062.833	\$ -	\$ -	\$ 331.809	\$ 406.048	\$ 5.641	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 40.989	\$ -51.831	\$ 8.385	\$ -265	\$ 140	\$ -294	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	276.127	238.901	30.088	7.259	11	14	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-363.755	-361.750	-20.636	-16.831	-19	-	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-87.628	-122.849	9.452	-9.572	-8	14	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-46.639	-174.680	17.837	-9.837	132	-280	-	-
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	741.529	916.209	78.098	87.935	4.254	4.534	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 694.890	\$ 741.529	\$ 95.935	\$ 78.098	\$ 4.386	\$ 4.254	\$ -	\$ -

(in Tsd.)	Legg Mason Japan Equity Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund ^{^β}		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	¥ -	¥ -	\$ 127	\$ -980	\$ -	\$ -	€ -	€ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	12	2.028	-	-	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	3	2	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-3.680	-13.630	-	-	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-3.665	-11.600	-	-	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	-3.538	-12.580	-	-	-	-
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	-	-	3.538	16.118	-	-	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	¥ -	¥ -	\$ -	\$ 3.538	\$ -	\$ -	€ -	€ -

(in Tsd.)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Improving Society Fund ^{^γ}		Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 31.961	€ -28.951	\$ 12	\$ -	€ 5.010	€ -644	\$ 1.545.078	\$ -2.460.329
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	12.962	29.019	6.174	-	71.613	37.528	6.373.287	8.183.142
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	45.932	20.855
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-45.142	-114.561	-	-	-25.742	-61	-9.527.821	-10.861.926
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-32.180	-85.542	6.174	-	45.871	37.467	-3.108.602	-2.657.929
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-219	-114.493	6.186	-	50.881	36.823	-1.563.524	-5.118.258
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	189.097	303.590	-	-	36.823	-	17.428.030	22.628.678
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	35.801	-82.390
Zum Jahresende	€ 188.878	€ 189.097	\$ 6.186	\$ -	€ 87.704	€ 36.823	\$ 15.900.307	\$ 17.428.030

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund ^{^δ}		Legg Mason Battery March International Large Cap Fund [^]		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]					
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023				
€	-	€	-931	\$	812	\$	-3.091	\$	-	\$	-	\$	166
-	305	53	2.902	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	98	88	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-27.711	-22.053	-4.692	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-12.709
-	-27.406	-21.902	-1.702	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-12.709
-	-28.337	-21.090	-4.793	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-12.543
-	28.337	21.090	25.883	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12.543
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
€	-	€	-	\$	-	\$	21.090	\$	-	\$	-	\$	-

Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]		FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]							
für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023						
\$	-	\$	-	\$	24.013	\$	-35.561	\$	-56	\$	-2.167	\$	586	\$	-8.563
-	-	-	-	23.348	65.616	81	853	3.711	14.408						
-	-	-	-	-	-	208	285	-	-						
-	-	-	-	-64.389	-58.387	-4.210	-1.784	-7.352	-18.981						
-	-	-	-	-41.041	7.229	-3.921	-646	-3.641	-4.573						
-	-	-	-	-17.028	-28.332	-3.977	-2.813	-3.055	-13.136						
-	-	-	-	141.049	169.381	25.121	27.934	34.702	47.838						
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-						
\$	-	\$	-	\$	124.021	\$	141.049	\$	21.144	\$	25.121	\$	31.647	\$	34.702

Als „-“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR/0 JPY/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 JPY/1.000 GBP.

Alle Euro-Beträge, außer des Anfang des Jahres den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnenden Nettovermögens, für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das am 29. Februar 2024 endende Geschäftsjahr zum durchschnittlichen USD/EUR-Kurs von 0,9232 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,9590).

Das den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnende Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] wurde zur Berechnung des Gesamtbetrags zum 28. Februar 2023 zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,9454 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,8919).

Alle Beträge in britischem Pfund, außer des zu Beginn des Geschäftsjahres den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnenden Nettovermögens, für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für Franklin Templeton Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 zum durchschnittlichen USD/GBP-Wechselkurs von 0,7988 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,8252).

Das den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnende Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurde zur Berechnung der Gesamtbeträge zum 28. Februar 2023 zum USD/GBP-Schlusskurs von 0,8314 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,7454).

α Mit Wirkung vom 24. März 2023 haben der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] den Handel eingestellt.

β Mit Wirkung vom 20. April 2023 hat der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] den Handel eingestellt.

γ Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 hat der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel aufgenommen.

δ Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 hat der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] den Handel eingestellt.

η Mit Wirkung vom 22. September 2023 hat der FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^] den Handel aufgenommen.

θ Mit Wirkung vom 23. Oktober 2023 hat der FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] den Handel eingestellt.

λ Mit Wirkung vom 6. November 2023 hat der FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^] den Handel aufgenommen.

μ Mit Wirkung vom 10. November 2023 hat der FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

¥ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2023 hat der FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	3.012	2.520			
Zurückgenommen	-2.409	-2.240			
Nettozunahme	603	280			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1.210.701	888.333			
Zurückgenommen	-999.630	-1.002.262			
Nettozunahme/-abnahme	211.071	-113.929			
Klasse B USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse B USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	-	218			
Zurückgenommen	-44	-			
Nettozunahme/-abnahme	-44	218			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	1	-			
Zurückgenommen	-	-50			
Nettozunahme/-abnahme	1	-50			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-134	-7			
Nettoabnahme	-134	-6			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	500.516	541.654			
Zurückgenommen	-508.670	-542.008			
Nettoabnahme	-8.154	-354			
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	8	73			
Zurückgenommen	-38	-107			
Nettoabnahme	-30	-34			
FTGF Western Asset US Core Bond Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	89	63			
Zurückgenommen	-95	-78			
Nettoabnahme	-6	-15			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	85	172			
Zurückgenommen	-62	-556			
Nettozunahme/-abnahme	23	-384			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	7	18			
Zurückgenommen	-22	-35			
Nettoabnahme	-15	-17			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	6	3			
Zurückgenommen	-6	-9			
Nettoabnahme	-	-6			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	4	5			
Zurückgenommen	-2	-18			
Nettozunahme/-abnahme	2	-13			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	889	156			
Zurückgenommen	-406	-329			
Nettozunahme/-abnahme	483	-173			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	85	40			
Zurückgenommen	-37	-48			
Nettozunahme/-abnahme	48	-8			
Klasse X USD, thesaurierend					
Verkauft	24	2			
Zurückgenommen	-31	-2			
Nettoabnahme	-7	-			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	-	16			
Zurückgenommen	-85	-104			
Nettoabnahme	-85	-88			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-	-23			
Nettoabnahme	-	-22			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	3	5			
Zurückgenommen	-9	-			
Nettozunahme/-abnahme	-6	5			
Klasse GA USD, thesaurierend					
Verkauft	2	-			
Zurückgenommen	-2	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	167	276			
Zurückgenommen	-255	-294			
Nettoabnahme	-88	-18			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	98	138			
Zurückgenommen	-84	-255			
Nettozunahme/-abnahme	14	-117			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	3	10			
Zurückgenommen	-9	-37			
Nettoabnahme	-6	-27			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	17	59			
Zurückgenommen	-117	-37			
Nettozunahme/-abnahme	-100	22			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	2	9			
Zurückgenommen	-3	-13			
Nettoabnahme	-1	-4			
Klasse B USD, ausschüttend (D)					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	29	24			
Zurückgenommen	-28	-54			
Nettozunahme/-abnahme	1	-30			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	11	6			
Zurückgenommen	-8	-19			
Nettozunahme/-abnahme	3	-13			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	15	39			
Zurückgenommen	-36	-89			
Nettoabnahme	-21	-50			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	1.383	2.966			
Zurückgenommen	-2.478	-3.556			
Nettoabnahme	-1.095	-590			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	79	28			
Zurückgenommen	-78	-45			
Nettozunahme/-abnahme	1	-17			
Klasse X USD, thesaurierend					
Verkauft	13	11			
Zurückgenommen	-14	-54			
Nettoabnahme	-1	-43			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	8			
Zurückgenommen	-3	-24			
Nettoabnahme	-2	-16			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	4			
Zurückgenommen	-2	-27			
Nettoabnahme	-2	-23			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	602	1.800			
Zurückgenommen	-1.927	-2.219			
Nettoabnahme	-1.325	-419			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)					
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	22	5			
Zurückgenommen	-4	-1			
Nettozunahme	18	4			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	61	277			
Zurückgenommen	-377	-146			
Nettozunahme/-abnahme	-316	131			
Klasse LM USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	20	42			
Zurückgenommen	-91	-78			
Nettoabnahme	-71	-36			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	-8	-1			
Nettoabnahme	-8	-1			
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	-			
Zurückgenommen	-2	-1			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	2	-			
Zurückgenommen	-3	-			
Nettoabnahme	-1	-			
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund					
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	13	-			
Nettozunahme	13	-			
Klasse A EUR, ausschüttend (D)					
Zurückgenommen	-	-2			
Nettoabnahme	-	-2			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	7	88			
Zurückgenommen	-34	-24			
Nettozunahme/-abnahme	-27	64			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	-895	-3			
Nettoabnahme	-895	-3			
Klasse GA EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	-2	-			
Nettoabnahme	-2	-			
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^A					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	-	9			
Zurückgenommen	-	-153			
Nettoabnahme	-	-144			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	-	9			
Zurückgenommen	-	-99			
Nettoabnahme	-	-90			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Zurückgenommen	-	-2			
Nettoabnahme	-	-2			
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Zurückgenommen	-	-3			
Nettoabnahme	-	-3			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-	-10			
Nettoabnahme	-	-9			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	-	7			
Zurückgenommen	-	-45			
Nettoabnahme	-	-38			
Klasse B USD, ausschüttend (D)					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	-	10			
Zurückgenommen	-	-57			
Nettoabnahme	-	-47			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	-	2			
Zurückgenommen	-	-48			
Nettoabnahme	-	-46			
Klasse F USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-29			
Nettoabnahme	-	-29			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	23			
Zurückgenommen	-	-23			
Nettozunahme	-	-			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-5			
Nettoabnahme	-	-5			
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-	-38			
Nettoabnahme	-	-37			
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-6			
Nettoabnahme	-	-6			
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)					
Zurückgenommen	-	-2			
Nettoabnahme	-	-2			
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	28	25			
Zurückgenommen	-21	-38			
Nettozunahme/-abnahme	7	-13			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	10	12			
Zurückgenommen	-33	-17			
Nettoabnahme	-23	-5			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	23	1			
Zurückgenommen	-14	-2			
Nettozunahme/-abnahme	9	-1			
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	10	16			
Zurückgenommen	-12	-22			
Nettoabnahme	-2	-6			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	2	3			
Zurückgenommen	-2	-1			
Nettozunahme	-	2			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	3	8			
Zurückgenommen	-14	-12			
Nettoabnahme	-11	-4			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	1	-			
Nettozunahme	1	-			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	5	8			
Zurückgenommen	-21	-10			
Nettoabnahme	-16	-2			
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Zurückgenommen	-	-5			
Nettoabnahme	-	-5			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	129	116			
Zurückgenommen	-157	-53			
Nettozunahme/-abnahme	-28	63			
Klasse B USD, ausschüttend (D)					
Zurückgenommen	-1	-2			
Nettoabnahme	-1	-2			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	3	11			
Zurückgenommen	-10	-11			
Nettoabnahme	-7	-			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)					
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	10	14			
Zurückgenommen	-17	-27			
Nettoabnahme	-7	-13			
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	320	7			
Zurückgenommen	-100	-7			
Nettozunahme	220	–			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	–	3			
Zurückgenommen	-1	-4			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse E USD, ausschüttend (D)					
Zurückgenommen	-2	–			
Nettoabnahme	-2	–			
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	1	–			
Nettozunahme	1	–			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	25	31			
Zurückgenommen	-19	-45			
Nettozunahme/-abnahme	6	-14			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Zurückgenommen	-8	–			
Nettoabnahme	-8	–			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	–			
Zurückgenommen	-1	-7			
Nettoabnahme	–	-7			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	2	–			
Nettozunahme	2	–			
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	52	256			
Zurückgenommen	-57	-298			
Nettoabnahme	-5	-42			
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	–	27			
Zurückgenommen	-1	-129			
Nettoabnahme	-1	-102			
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	522			
Zurückgenommen	–	-28			
Nettozunahme	–	494			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-5	-21			
Nettoabnahme	-5	-20			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-266			
Nettoabnahme	–	-266			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	2	–			
Zurückgenommen	-2	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	1	–			
Zurückgenommen	-7	-15			
Nettoabnahme	-6	-15			
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	11	1			
Zurückgenommen	-26	-27			
Nettoabnahme	-15	-26			
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	81	72			
Zurückgenommen	–	-350			
Nettozunahme/-abnahme	81	-278			
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettozunahme	–	–			
FTGF Western Asset US High Yield Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	16	32			
Zurückgenommen	-39	-56			
Nettoabnahme	-23	-24			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	77	108			
Zurückgenommen	-127	-143			
Nettoabnahme	-50	-35			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	17	2			
Zurückgenommen	-11	-14			
Nettozunahme/-abnahme	6	-12			
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	2	5			
Zurückgenommen	-4	-12			
Nettoabnahme	-2	-7			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	–	4			
Zurückgenommen	-1	–			
Nettozunahme/-abnahme	-1	4			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	3	2			
Zurückgenommen	-3	-2			
Nettozunahme	–	–			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	1.044	22			
Zurückgenommen	-604	-153			
Nettozunahme/-abnahme	440	-131			
Klasse B USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-2			
Klasse B USD, ausschüttend (D)					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	2	9			
Zurückgenommen	-2	-2			
Nettozunahme	–	7			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	3	3			
Zurückgenommen	-8	-7			
Nettoabnahme	-5	-4			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	3	7			
Zurückgenommen	-9	-8			
Nettoabnahme	-6	-1			
Klasse E USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-2	-5			
Nettoabnahme	-2	-4			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	1	18			
Zurückgenommen	-10	-34			
Nettoabnahme	-9	-16			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	2			
Zurückgenommen	-2	-1			
Nettozunahme/-abnahme	-1	1			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	54	405			
Zurückgenommen	-149	-749			
Nettoabnahme	-95	-344			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	5	–			
Zurückgenommen	-5	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-232			
Nettoabnahme	–	-232			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US High Yield Fund – (Fortsetzung)		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	23	18
Zurückgenommen	-101	–
Nettozunahme/-abnahme	-78	18
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	–
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-32
Nettoabnahme	–	-32
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	–	-14
Nettoabnahme	–	-14
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	19
Zurückgenommen	–	-19
Nettozunahme	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Zurückgenommen	–	-10
Nettoabnahme	–	-10
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	112
Zurückgenommen	–	-129
Nettoabnahme	–	-17
Klasse C USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	–	-10
Nettoabnahme	–	-10
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-5
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-15
Nettoabnahme	–	-15
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse LM USD, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	105
Zurückgenommen	–	-393
Nettoabnahme	–	-288
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	–	-9
Nettoabnahme	–	-9
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-7
Nettoabnahme	–	-7
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	–	-10
Nettoabnahme	–	-10

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-18
Nettoabnahme	–	-18
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	–	-290
Nettoabnahme	–	-286
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	5	10
Zurückgenommen	-9	-25
Nettoabnahme	-4	-15
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	4	17
Zurückgenommen	-6	-22
Nettoabnahme	-2	-5
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	7	11
Zurückgenommen	-18	-73
Nettoabnahme	-11	-62
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	5	58
Zurückgenommen	-24	-75
Nettoabnahme	-19	-17
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	13	55
Zurückgenommen	-29	-70
Nettoabnahme	-16	-15
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-4	-2
Nettozunahme/-abnahme	-4	3
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	2.541	525
Zurückgenommen	-2.385	-855
Nettozunahme/-abnahme	156	-330
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-3
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-12	-3
Nettoabnahme	-10	-3
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-3	-1
Nettoabnahme	-3	–
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	8	13
Zurückgenommen	-17	-7
Nettozunahme/-abnahme	-9	6
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-1	-6
Nettoabnahme	–	-4
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	52	5
Zurückgenommen	-62	-12
Nettoabnahme	-10	-7
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	46	10
Zurückgenommen	-49	-7
Nettozunahme/-abnahme	-3	3

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)					
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-29			
Nettoabnahme	–	-29			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	8	8			
Zurückgenommen	-16	-1			
Nettozunahme/-abnahme	-8	7			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-6	-1			
Nettoabnahme	-6	-1			
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-2	-2			
Nettoabnahme	-2	-1			
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	5	1			
Zurückgenommen	-5	–			
Nettozunahme	–	1			
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^A					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	–	18			
Zurückgenommen	–	-41			
Nettoabnahme	–	-23			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	7			
Zurückgenommen	–	-43			
Nettoabnahme	–	-36			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	–	-6			
Nettoabnahme	–	-6			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	–	11			
Zurückgenommen	–	-11			
Nettozunahme	–	–			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	12			
Zurückgenommen	–	-75			
Nettoabnahme	–	-63			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-369			
Nettoabnahme	–	-369			
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	40	57			
Zurückgenommen	-69	-102			
Nettoabnahme	-29	-45			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	6			
Zurückgenommen	-8	-9			
Nettoabnahme	-7	-3			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	92	89			
Zurückgenommen	-149	-241			
Nettoabnahme	-57	-152			
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	8	28			
Zurückgenommen	-63	-50			
Nettoabnahme	-55	-22			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	31	127			
Zurückgenommen	-71	-200			
Nettoabnahme	-40	-73			
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-3	–			
Nettoabnahme	-3	–			
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft	2.257	53			
Zurückgenommen	-162	-117			
Nettozunahme/-abnahme	2.095	-64			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	5			
Zurückgenommen	-1	-10			
Nettoabnahme	-1	-5			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	2			
Zurückgenommen	-3	-5			
Nettoabnahme	-2	-3			
Klasse A EUR, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	6	64			
Zurückgenommen	-117	-358			
Nettoabnahme	-111	-294			
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	468	34			
Zurückgenommen	-556	-540			
Nettoabnahme	-88	-506			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	9.697	254			
Zurückgenommen	-9.490	-1.658			
Nettozunahme/-abnahme	207	-1.404			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	49	603			
Zurückgenommen	-421	-1.017			
Nettoabnahme	-372	-414			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	1	–			
Zurückgenommen	-2	-1			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Zurückgenommen	-4	–			
Nettoabnahme	-4	–			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-2	-1			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	–	6			
Zurückgenommen	-9	-7			
Nettoabnahme	-9	-1			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	–			
Nettozunahme	1	–			
Klasse X USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-2			
Klasse X USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-1	-26			
Nettoabnahme	-1	-25			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-2	–			
Nettoabnahme	-2	–			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	85	156			
Zurückgenommen	-267	-56			
Nettozunahme/-abnahme	-182	100			
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	36	39			
Zurückgenommen	-49	-26			
Nettozunahme/-abnahme	-13	13			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	53	51			
Zurückgenommen	-93	-44			
Nettozunahme/-abnahme	-40	7			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	-557	–			
Nettoabnahme	-557	–			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-470	–			
Nettoabnahme	-470	–			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-63	-84			
Nettoabnahme	-63	-84			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)					
Klasse LM USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	3	59			
Zurückgenommen	-32	-10			
Nettozunahme/-abnahme	-29	49			
Klasse LM EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	19	15			
Zurückgenommen	-19	-10			
Nettozunahme	–	5			
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	133	225			
Zurückgenommen	-134	-147			
Nettozunahme/-abnahme	-1	78			
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	61	30			
Zurückgenommen	-34	-19			
Nettozunahme	27	11			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	100	197			
Zurückgenommen	-170	-66			
Nettozunahme/-abnahme	-70	131			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	–	3			
Zurückgenommen	-3	–			
Nettozunahme/-abnahme	-3	3			
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	857	1.454			
Zurückgenommen	-1.106	-2.223			
Nettoabnahme	-249	-769			
Klasse B USD, thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-1	–			
Nettozunahme/-abnahme	-1	1			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	17	12			
Zurückgenommen	-20	-49			
Nettoabnahme	-3	-37			
Klasse C USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	8	37			
Zurückgenommen	-8	-5			
Nettozunahme	–	32			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	8	19			
Zurückgenommen	-7	-17			
Nettozunahme	1	2			
Klasse E USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-38	–			
Nettozunahme/-abnahme	-38	1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	1	12			
Zurückgenommen	-5	-44			
Nettoabnahme	-4	-32			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-12	-3			
Nettoabnahme	-11	-2			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	255	48			
Zurückgenommen	-145	-46			
Nettozunahme	110	2			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	72	334			
Zurückgenommen	-170	-339			
Nettoabnahme	-98	-5			
Klasse Premier CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	42	–			
Nettozunahme	42	–			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	353	666			
Zurückgenommen	-891	-287			
Nettozunahme/-abnahme	-538	379			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	2	2			
Zurückgenommen	–	-4			
Nettozunahme/-abnahme	2	-2			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	4			
Zurückgenommen	-4	–			
Nettozunahme/-abnahme	-3	4			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-1	-10			
Nettoabnahme	–	-9			
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	335	272			
Zurückgenommen	-67	-70			
Nettozunahme	268	202			
S Klasse EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
S Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	108	49			
Zurückgenommen	-45	-8			
Nettozunahme	63	41			
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	1.325	1.035			
Zurückgenommen	-1.593	-454			
Nettozunahme/-abnahme	-268	581			
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-155	–			
Nettoabnahme	-155	–			
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^					
Klasse X USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-5	-7			
Nettoabnahme	-5	-7			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	137	84			
Zurückgenommen	-125	-179			
Nettozunahme/-abnahme	12	-95			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	160	124			
Zurückgenommen	-154	-238			
Nettozunahme/-abnahme	6	-114			
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	66	–			
Zurückgenommen	-110	–			
Nettoabnahme	-44	–			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	3	6			
Zurückgenommen	-8	-2			
Nettozunahme/-abnahme	-5	4			
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	25			
Zurückgenommen	-21	-27			
Nettoabnahme	-21	-2			
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-250	–			
Nettoabnahme	-250	–			
FTGF Western Asset Global Credit Fund^					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-12	-6			
Nettoabnahme	-11	-5			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	2			
Zurückgenommen	-1	-2			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^] – (Fortsetzung)				
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	7	–		
Zurückgenommen	-107	-152		
Nettoabnahme	-100	-152		
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	54	6		
Zurückgenommen	-53	-2		
Nettozunahme	1	4		
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]				
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Zurückgenommen	–	-205		
Nettoabnahme	–	-205		
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]				
Klasse A USD, thesaurierend				
Verkauft	313	422		
Zurückgenommen	-1.562	-3.118		
Nettoabnahme	-1.249	-2.696		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	173	432		
Zurückgenommen	-472	-1.059		
Nettoabnahme	-299	-627		
Klasse A USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	67	43		
Zurückgenommen	-125	-140		
Nettoabnahme	-58	-97		
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	9	1		
Zurückgenommen	-2	-2		
Nettozunahme/-abnahme	7	-1		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	43	18		
Zurückgenommen	-94	-103		
Nettoabnahme	-51	-85		
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	4	7		
Zurückgenommen	-22	-96		
Nettoabnahme	-18	-89		
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	7		
Zurückgenommen	-4	-7		
Nettoabnahme	-4	–		
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Zurückgenommen	-86	-82		
Nettoabnahme	-86	-82		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1.410	779		
Zurückgenommen	-1.260	-2.137		
Nettozunahme/-abnahme	150	-1.358		
Klasse A EUR, ausschüttend (A)				
Verkauft	8	6		
Zurückgenommen	-22	-24		
Nettoabnahme	-14	-18		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	1	6		
Zurückgenommen	-22	-18		
Nettoabnahme	-21	-12		
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)				
Verkauft	8	10		
Zurückgenommen	-11	-9		
Nettozunahme/-abnahme	-3	1		
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	7	2		
Zurückgenommen	-26	-98		
Nettoabnahme	-19	-96		
Klasse A GBP, thesaurierend				
Verkauft	1	–		
Zurückgenommen	-2	-1		
Nettoabnahme	-1	-1		
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	35	5		
Zurückgenommen	-73	-15		
Nettoabnahme	-38	-10		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus				
Zurückgenommen	-7	–		
Nettoabnahme	-7	–		
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	14	33		
Zurückgenommen	-67	-172		
Nettoabnahme	-53	-139		
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	6.079	–		
Zurückgenommen	-10.142	-12.989		
Nettoabnahme	-4.063	-12.989		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	1.611	2.598		
Zurückgenommen	-13.899	-18.843		
Nettoabnahme	-12.288	-16.245		
Klasse B USD, thesaurierend				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	16	36		
Zurückgenommen	-70	-127		
Nettoabnahme	-54	-91		
Klasse C USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	4	1		
Zurückgenommen	-8	-13		
Nettoabnahme	-4	-12		
Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	2	2		
Zurückgenommen	–	-2		
Nettozunahme	2	–		
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	346	379		
Zurückgenommen	-554	-326		
Nettozunahme/-abnahme	-208	53		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	11	18		
Zurückgenommen	-59	-50		
Nettoabnahme	-48	-32		
Klasse E USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	–	2		
Zurückgenommen	-5	-7		
Nettoabnahme	-5	-5		
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	2	1		
Zurückgenommen	-6	-10		
Nettoabnahme	-4	-9		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	34	157		
Zurückgenommen	-200	-711		
Nettoabnahme	-166	-554		
Klasse F USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	13	5		
Zurückgenommen	-53	-43		
Nettoabnahme	-40	-38		
Klasse X USD, thesaurierend				
Verkauft	91	113		
Zurückgenommen	-374	-809		
Nettoabnahme	-283	-696		
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	57	24		
Zurückgenommen	-218	-223		
Nettoabnahme	-161	-199		
Klasse X USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	4	9		
Zurückgenommen	-44	-83		
Nettoabnahme	-40	-74		
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	2	49		
Zurückgenommen	-24	-180		
Nettoabnahme	-22	-131		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	569	1.583		
Zurückgenommen	-577	-2.307		
Nettoabnahme	-8	-724		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] – (Fortsetzung)					
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-3	-18			
Nettoabnahme	-2	-17			
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft	2	39			
Zurückgenommen	-81	-42			
Nettoabnahme	-79	-3			
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Zurückgenommen	-24	-38			
Nettoabnahme	-24	-38			
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	19	56			
Zurückgenommen	-150	-232			
Nettoabnahme	-131	-176			
Klasse X GBP, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-3			
Nettoabnahme	-	-3			
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	5	3			
Zurückgenommen	-12	-40			
Nettoabnahme	-7	-37			
Klasse X SGD thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	676	1.105			
Zurückgenommen	-3.224	-1.369			
Nettoabnahme	-2.548	-264			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	107	984			
Zurückgenommen	-1.673	-1.350			
Nettoabnahme	-1.566	-366			
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)					
Verkauft	9	10			
Zurückgenommen	-110	-304			
Nettoabnahme	-101	-294			
Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-1	-17			
Nettoabnahme	-1	-16			
Klasse Premier AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	7	13			
Zurückgenommen	-37	-574			
Nettoabnahme	-30	-561			
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	19	92			
Zurückgenommen	-513	-3.104			
Nettoabnahme	-494	-3.012			
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	8			
Zurückgenommen	-13	-112			
Nettoabnahme	-12	-104			
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)					
Verkauft	-	9			
Zurückgenommen	-1	-20			
Nettoabnahme	-1	-11			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	483	1.114			
Zurückgenommen	-2.982	-2.581			
Nettoabnahme	-2.499	-1.467			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	217	12			
Zurückgenommen	-268	-60			
Nettoabnahme	-51	-48			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)					
Verkauft	223	318			
Zurückgenommen	-356	-98			
Nettozunahme/-abnahme	-133	220			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	11	21			
Zurückgenommen	-33	-513			
Nettoabnahme	-22	-492			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	131	71			
Zurückgenommen	-162	-1.114			
Nettoabnahme	-31	-1.043			
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	3	101			
Zurückgenommen	-24	-165			
Nettoabnahme	-21	-64			
Klasse Premier JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)					
Zurückgenommen	-	-100			
Nettoabnahme	-	-100			
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	37	24			
Zurückgenommen	-15	-35			
Nettozunahme/-abnahme	22	-11			
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft	9	-			
Zurückgenommen	-9	-83			
Nettoabnahme	-	-83			
S Klasse EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	3	-			
Zurückgenommen	-1.212	-9			
Nettoabnahme	-1.209	-9			
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)					
Verkauft	68	72			
Zurückgenommen	-234	-738			
Nettoabnahme	-166	-666			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-5	-2			
Nettoabnahme	-4	-1			
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]					
Klasse A USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	19			
Zurückgenommen	-	-50			
Nettoabnahme	-	-31			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Zurückgenommen	-2	-3			
Nettoabnahme	-2	-3			
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft	16	1			
Zurückgenommen	-18	-3			
Nettoabnahme	-2	-2			
S Klasse EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	80	40			
Zurückgenommen	-108	-31			
Nettozunahme/-abnahme	-28	9			
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	59	50			
Zurückgenommen	-27	-29			
Nettozunahme	32	21			
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-	-1.230			
Nettoabnahme	-	-1.230			
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	175	25			
Zurückgenommen	-85	-65			
Nettozunahme/-abnahme	90	-40			
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	515	418			
Zurückgenommen	-128	-206			
Nettozunahme	387	212			
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	7	271			
Zurückgenommen	-36	-9			
Nettozunahme/-abnahme	-29	262			
Klasse S CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft	-	40			
Nettozunahme	-	40			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]					
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	9	14			
Zurückgenommen	-9	-10			
Nettozunahme	-	4			
Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Zurückgenommen	-5	-			
Nettoabnahme	-5	-			
Klasse D USD, thesaurierend					
Verkauft	5	3			
Zurückgenommen	-110	-17			
Nettoabnahme	-105	-14			
Klasse D USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	-	2			
Zurückgenommen	-9	-2			
Nettoabnahme	-9	-			
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-2	-10			
Nettoabnahme	-2	-10			
Klasse M GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Zurückgenommen	-	-6			
Nettoabnahme	-	-6			
Klasse F USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-4			
Nettoabnahme	-	-4			
Klasse M USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-7			
Nettoabnahme	-	-7			
Klasse M USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	2	1			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettozunahme	1	-			
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-	-8			
Nettoabnahme	-	-8			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	84	82			
Zurückgenommen	-167	-1.417			
Nettoabnahme	-83	-1.335			
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)					
Verkauft	19	-			
Zurückgenommen	-14	-7			
Nettozunahme/-abnahme	5	-7			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	8			
Zurückgenommen	-32	-1.094			
Nettoabnahme	-31	-1.086			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert)					
Verkauft	1	3			
Zurückgenommen	-6	-175			
Nettoabnahme	-5	-172			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Zurückgenommen	-1	-105			
Nettoabnahme	-1	-105			
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-500	-			
Nettoabnahme	-500	-			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-705			
Nettoabnahme	-	-705			
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]					
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	30	585			
Nettozunahme	30	585			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	19			
Zurückgenommen	-	-25			
Nettoabnahme	-	-6			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	-	266			
Nettozunahme	-	266			
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]					
Klasse LM GBP, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-637			
Nettoabnahme	-	-637			
Klasse LM GBP, ausschüttend (M)					
Verkauft	-	700			
Zurückgenommen	-504	-196			
Nettozunahme/-abnahme	-504	504			
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]					
Klasse A USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	-4			
Nettoabnahme	-1	-4			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	-	7			
Zurückgenommen	-164	-14			
Nettoabnahme	-164	-7			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	31			
Zurückgenommen	-	-38			
Nettoabnahme	-	-7			
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-	-951			
Nettoabnahme	-	-951			
Klasse LM GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	-	1.075			
Zurückgenommen	-704	-371			
Nettozunahme/-abnahme	-704	704			
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]					
Klasse LM USD, ausschüttend (Q)					
Verkauft	12	12			
Zurückgenommen	-8	-6			
Nettozunahme	4	6			
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]					
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-25	-			
Nettoabnahme	-25	-			
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-140	-2			
Nettoabnahme	-140	-2			
Klasse S USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-48	-			
Nettoabnahme	-48	-			
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	19	8			
Zurückgenommen	-34	-16			
Nettoabnahme	-15	-8			
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	13	12			
Zurückgenommen	-10	-17			
Nettozunahme/-abnahme	3	-5			
Klasse A USD, ausschüttend (S)					
Verkauft	29	35			
Zurückgenommen	-59	-39			
Nettoabnahme	-30	-4			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Zurückgenommen	-5	-			
Nettoabnahme	-5	-			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft	37	9			
Zurückgenommen	-48	-54			
Nettoabnahme	-11	-45			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	5			
Zurückgenommen	-3	-6			
Nettoabnahme	-2	-1			
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Zurückgenommen	-3	-2			
Nettoabnahme	-3	-2			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)					
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)					
Verkauft	4	2			
Zurückgenommen	-10	-5			
Nettoabnahme	-6	-3			
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-2	–			
Nettozunahme/-abnahme	-2	1			
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)					
Verkauft	3	5			
Zurückgenommen	-7	-10			
Nettoabnahme	-4	-5			
Klasse A SGD, thesaurierend					
Verkauft	1.858	5			
Zurückgenommen	-1.854	-1			
Nettozunahme	4	4			
Klasse B USD, ausschüttend (S)					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	1	–			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse C USD, ausschüttend (S)					
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	4	3			
Zurückgenommen	-4	-1			
Nettozunahme	–	2			
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	1	2			
Zurückgenommen	-1	-10			
Nettoabnahme	–	-8			
Klasse F USD, ausschüttend (S)					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse X USD, thesaurierend					
Verkauft	1	59			
Zurückgenommen	-3	-62			
Nettoabnahme	-2	-3			
Klasse X USD, ausschüttend (S)					
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-2			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft	7	–			
Zurückgenommen	-2	-8			
Nettozunahme/-abnahme	5	-8			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)					
Zurückgenommen	–	-5			
Nettoabnahme	–	-5			
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	19	33			
Zurückgenommen	-30	-130			
Nettoabnahme	-11	-97			
Klasse X GBP, thesaurierend					
Verkauft	30	142			
Zurückgenommen	-67	-178			
Nettoabnahme	-37	-36			
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)					
Verkauft	20	9			
Zurückgenommen	-22	-21			
Nettoabnahme	-2	-12			
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)					
Verkauft	70	15			
Zurückgenommen	-80	-38			
Nettoabnahme	-10	-23			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	6	–			
Zurückgenommen	-11	-6			
Nettoabnahme	-5	-6			
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-2	-10			
Nettoabnahme	-2	-9			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft	25	20			
Zurückgenommen	-7	-63			
Nettozunahme/-abnahme	18	-43			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	43			
Zurückgenommen	-8	-20			
Nettozunahme/-abnahme	-8	23			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Zurückgenommen	-5	-6			
Nettoabnahme	-5	-4			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-2			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)					
Verkauft	2	–			
Zurückgenommen	-5	-7			
Nettoabnahme	-3	-7			
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft	22	187			
Zurückgenommen	-54	-38			
Nettozunahme/-abnahme	-32	149			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	2	5			
Zurückgenommen	-6	–			
Nettozunahme/-abnahme	-4	5			
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Zurückgenommen	-2	-3			
Nettoabnahme	-2	-1			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	–	-3			
Nettoabnahme	–	-2			
Klasse A SGD, thesaurierend					
Verkauft	3.319	11.942			
Zurückgenommen	-3.318	-11.941			
Nettozunahme	1	1			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	5	–			
Zurückgenommen	-2	–			
Nettozunahme	3	–			
Klasse E USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-5	-2			
Nettoabnahme	-5	-2			
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-4			
Nettoabnahme	–	-4			
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	–	4			
Zurückgenommen	-3	-1			
Nettozunahme/-abnahme	-3	3			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	305	1.645			
Zurückgenommen	-1.279	-343			
Nettozunahme/-abnahme	-974	1.302			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^] – (Fortsetzung)					
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-2	-			
Nettoabnahme	-2	-			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	26	592			
Zurückgenommen	-946	-268			
Nettozunahme/-abnahme	-920	324			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft	11	7			
Zurückgenommen	-348	-			
Nettozunahme/-abnahme	-337	7			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	113	-			
Zurückgenommen	-83	-			
Nettozunahme	30	-			
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-1.698	-3.246			
Nettoabnahme	-1.698	-3.246			
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	20	-			
Zurückgenommen	-1	-			
Nettozunahme	19	-			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	22	-			
Zurückgenommen	-7	-			
Nettozunahme	15	-			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	-			
Nettozunahme	1	-			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	89	-			
Zurückgenommen	-48	-			
Nettozunahme	41	-			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)					
Verkauft	74	-			
Nettozunahme	74	-			
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	28	11			
Zurückgenommen	-32	-8			
Nettozunahme/-abnahme	-4	3			
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-2	-1			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse A SGD, thesaurierend					
Verkauft	6.758	10			
Zurückgenommen	-6.773	-41			
Nettoabnahme	-15	-31			
Klasse C USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-	-9			
Nettoabnahme	-	-9			
Klasse F USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-5	-3			
Nettoabnahme	-5	-3			
Klasse X USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-3	-			
Nettoabnahme	-3	-			
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)					
Zurückgenommen	-2	-			
Nettoabnahme	-2	-			
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	-	2			
Zurückgenommen	-2	-3			
Nettoabnahme	-2	-1			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	290	56			
Zurückgenommen	-264	-56			
Nettozunahme	26	-			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)					
Verkauft			1		
Zurückgenommen			-2		
Nettozunahme/-abnahme			-1		
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft				3	
Nettozunahme				3	
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Verkauft			1		
Zurückgenommen			-22		
Nettoabnahme			-21		
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft			7		
Zurückgenommen			-30		
Nettoabnahme			-23		
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft			390		418
Zurückgenommen			-454		-566
Nettoabnahme			-64		-148
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft			3		9
Zurückgenommen			-7		-11
Nettoabnahme			-4		-2
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft			45		58
Zurückgenommen			-37		-163
Nettozunahme/-abnahme			8		-105
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft			153		133
Zurückgenommen			-352		-568
Nettoabnahme			-199		-435
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft			102		232
Zurückgenommen			-202		-489
Nettoabnahme			-100		-257
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			3		-
Zurückgenommen			-		-2
Nettozunahme/-abnahme			3		-2
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft			28		4
Zurückgenommen			-36		-29
Nettoabnahme			-8		-25
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft			58		21
Zurückgenommen			-15		-23
Nettozunahme/-abnahme			43		-2
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			195		115
Zurückgenommen			-102		-201
Nettozunahme/-abnahme			93		-86
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft			179		67
Zurückgenommen			-192		-59
Nettozunahme/-abnahme			-13		8
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft			79		125
Zurückgenommen			-109		-89
Nettozunahme/-abnahme			-30		36
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft			3		3
Zurückgenommen			-6		-6
Nettoabnahme			-3		-3
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft			10		13
Zurückgenommen			-13		-14
Nettoabnahme			-3		-1
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft			4		11
Zurückgenommen			-6		-14
Nettoabnahme			-2		-3
Klasse A HKD, thesaurierend					
Verkauft			12		4
Zurückgenommen			-9		-14
Nettozunahme/-abnahme			3		-10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	64	21
Zurückgenommen	-242	-517
Nettoabnahme	-178	-496
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	9.353	50.704
Zurückgenommen	-9.625	-14.808
Nettozunahme/-abnahme	-272	35.896
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	3.406	45.172
Zurückgenommen	-7.331	-52.806
Nettoabnahme	-3.925	-7.634
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	132	10.980
Zurückgenommen	-3.140	-14.908
Nettoabnahme	-3.008	-3.928
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	69	121
Zurückgenommen	-144	-265
Nettoabnahme	-75	-144
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	31	107
Zurückgenommen	-4	-4
Nettozunahme	27	103
Klasse A CZK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	178	69
Zurückgenommen	-142	-78
Nettozunahme/-abnahme	36	-9
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	5	4
Zurückgenommen	-2	-3
Nettozunahme	3	1
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	20	10
Zurückgenommen	-11	-9
Nettozunahme	9	1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	62	78
Zurückgenommen	-124	-205
Nettoabnahme	-62	-127
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	11	12
Zurückgenommen	-11	-21
Nettoabnahme	–	-9
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	19	19
Zurückgenommen	-75	-60
Nettoabnahme	-56	-41
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	-4	-1
Nettozunahme/-abnahme	-4	3
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	4	43
Zurückgenommen	-36	-96
Nettoabnahme	-32	-53
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-11
Nettoabnahme	-1	-10
Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Zurückgenommen	-5	-24
Nettoabnahme	-5	-24
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	12	59
Zurückgenommen	-93	-226
Nettoabnahme	-81	-167
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	–	-2

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	16	11
Zurückgenommen	-64	-33
Nettoabnahme	-48	-22
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	1	13
Zurückgenommen	-25	-35
Nettoabnahme	-24	-22
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	654	121
Zurückgenommen	-332	-375
Nettozunahme/-abnahme	322	-254
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	7	91
Zurückgenommen	-46	-79
Nettozunahme/-abnahme	-39	12
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	4
Zurückgenommen	-115	-1
Nettozunahme/-abnahme	-114	3
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	172	495
Zurückgenommen	-399	-716
Nettoabnahme	-227	-221
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	308	310
Zurückgenommen	-307	-207
Nettozunahme	1	103
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	5	67
Zurückgenommen	-72	-15
Nettozunahme/-abnahme	-67	52
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	53	1
Zurückgenommen	-22	-61
Nettozunahme/-abnahme	31	-60
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	213	193
Zurückgenommen	-297	-1.031
Nettoabnahme	-84	-838
Klasse S USD, ausschüttend (Q) Plus (e)		
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
S Klasse EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	67	178
Zurückgenommen	-192	-264
Nettoabnahme	-125	-86
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	2	5
Zurückgenommen	-9	-3
Nettozunahme/-abnahme	-7	2
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	2	2
Zurückgenommen	-4	-13
Nettoabnahme	-2	-11
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	84	215
Zurückgenommen	-50	-100
Nettozunahme	34	115
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	8	15
Zurückgenommen	-34	-19
Nettoabnahme	-26	-4
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	269	1.038
Zurückgenommen	-304	-84
Nettozunahme/-abnahme	-35	954
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	12	169
Zurückgenommen	-63	-151
Nettozunahme/-abnahme	-51	18

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-106	–			
Nettozunahme/-abnahme	-106	1			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	34	17			
Zurückgenommen	-193	-63			
Nettoabnahme	-159	-46			
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^{^α}					
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)					
Zurückgenommen	-100	–			
Nettoabnahme	-100	–			
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]					
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	104			
Zurückgenommen	–	-5.710			
Nettoabnahme	–	-5.606			
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-237			
Nettoabnahme	–	-237			
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]					
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	–	1			
Nettozunahme	–	1			
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft	–	148			
Nettozunahme	–	148			
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	–	1			
Nettozunahme	–	1			
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^{^λ}					
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft	320	–			
Zurückgenommen	-20	–			
Nettozunahme	300	–			
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^{^α}					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Zurückgenommen	-3	–			
Nettozunahme/-abnahme	-3	2			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-3	–			
Nettoabnahme	-3	–			
S Klasse EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-7	–			
Nettoabnahme	-7	–			
FTGF ClearBridge Value Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	170	402			
Zurückgenommen	-271	-370			
Nettozunahme/-abnahme	-101	32			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	14	19			
Zurückgenommen	-31	-23			
Nettoabnahme	-17	-4			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	3	55			
Zurückgenommen	-25	-29			
Nettozunahme/-abnahme	-22	26			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	79	54			
Zurückgenommen	-44	-44			
Nettozunahme	35	10			
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-1	–			
Nettozunahme/-abnahme	-1	1			
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	270	262			
Zurückgenommen	-436	-573			
Nettoabnahme	-166	-311			
Klasse A SGD, thesaurierend					
Verkauft	1.138	1.549			
Zurückgenommen	-691	-1.320			
Nettozunahme	447	229			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	7	43			
Zurückgenommen	-28	-27			
Nettozunahme/-abnahme	-21	16			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	3			
Zurückgenommen	-2	-2			
Nettozunahme/-abnahme	-1	1			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	7	32			
Zurückgenommen	-21	-18			
Nettozunahme/-abnahme	-14	14			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	24	40			
Zurückgenommen	-27	-35			
Nettozunahme/-abnahme	-3	5			
Klasse F USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	–			
Zurückgenommen	-1	-14			
Nettoabnahme	–	-14			
Klasse U USD, thesaurierend					
Verkauft	991	–			
Zurückgenommen	-42	–			
Nettozunahme	949	–			
Klasse X USD, thesaurierend					
Verkauft	15	5			
Zurückgenommen	-1	-4			
Nettozunahme	14	1			
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	34	19			
Zurückgenommen	-27	-78			
Nettozunahme/-abnahme	7	-59			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	37	89			
Zurückgenommen	-31	-94			
Nettozunahme/-abnahme	6	-5			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	305	370			
Zurückgenommen	-446	-203			
Nettozunahme/-abnahme	-141	167			
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	11			
Zurückgenommen	-12	-1			
Nettozunahme/-abnahme	-12	10			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1.060	508			
Zurückgenommen	-687	-231			
Nettozunahme	373	277			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	376	124			
Zurückgenommen	-327	-185			
Nettozunahme/-abnahme	49	-61			
LM Klasse USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	9	7			
Zurückgenommen	-27	-48			
Nettoabnahme	-18	-41			
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	26	19			
Zurückgenommen	-41	-26			
Nettoabnahme	-15	-7			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	12	3
Zurückgenommen	-18	-11
Nettoabnahme	-6	-8
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	4	2
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	2	2
Klasse B USD, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	2	3
Zurückgenommen	-9	-8
Nettoabnahme	-7	-5
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-3	-6
Nettoabnahme	-3	-3
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	3	5
Zurückgenommen	-17	-11
Nettoabnahme	-14	-6
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	9	15
Zurückgenommen	-30	-28
Nettoabnahme	-21	-13
Klasse F USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	3
Zurückgenommen	-3	-2
Nettozunahme/-abnahme	-1	1
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
Klasse X EUR, thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	6	18
Zurückgenommen	-15	-26
Nettoabnahme	-9	-8
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-1	-3
Nettoabnahme	-1	-3
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	37	23
Zurückgenommen	-34	-2
Nettozunahme	3	21
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	7	11
Zurückgenommen	-24	-8
Nettozunahme/-abnahme	-17	3
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-6	-2
Nettoabnahme	-5	-1
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-2	-4
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	157	104
Zurückgenommen	-184	-173
Nettoabnahme	-27	-69

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	25	23
Zurückgenommen	-30	-32
Nettoabnahme	-5	-9
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	54	33
Zurückgenommen	-21	-28
Nettozunahme	33	5
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	23	24
Zurückgenommen	-23	-55
Nettoabnahme	–	-31
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	12	5
Zurückgenommen	-22	-9
Nettoabnahme	-10	-4
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-4	-9
Nettoabnahme	-3	-8
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	7	9
Zurückgenommen	-14	-18
Nettoabnahme	-7	-9
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	102	210
Zurückgenommen	-416	-209
Nettozunahme/-abnahme	-314	1
Klasse F USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	27	5
Zurückgenommen	-39	-40
Nettoabnahme	-12	-35
Klasse U USD, thesaurierend		
Verkauft	338	442
Zurückgenommen	-575	-742
Nettoabnahme	-237	-300
Klasse U USD, ausschüttend (Q)		
Verkauft	83	–
Nettozunahme	83	–
Klasse U EUR, thesaurierend		
Verkauft	564	22
Zurückgenommen	-240	-350
Nettozunahme/-abnahme	324	-328
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	54	54
Zurückgenommen	-81	-40
Nettozunahme/-abnahme	-27	14
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	37	8
Zurückgenommen	-9	-27
Nettozunahme/-abnahme	28	-19
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	15	4
Zurückgenommen	-3	-2
Nettozunahme	12	2
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	30	15
Zurückgenommen	-22	-14
Nettozunahme	8	1
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	785	645
Zurückgenommen	-439	-810
Nettozunahme/-abnahme	346	-165
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	13
Zurückgenommen	-14	-18
Nettoabnahme	-12	-5
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	144	–
Zurückgenommen	-272	-761
Nettoabnahme	-128	-761

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	401	107
Zurückgenommen	-295	-94
Nettozunahme	106	13
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	86	29
Zurückgenommen	-72	-177
Nettozunahme/-abnahme	14	-148
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	13	5
Zurückgenommen	-5	-2
Nettozunahme	8	3
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	157	58
Zurückgenommen	-94	-108
Nettozunahme/-abnahme	63	-50
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	34	430
Zurückgenommen	-211	-472
Nettoabnahme	-177	-42
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	-
Nettoabnahme	-1	-
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	-	1
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	-	-1
Nettoabnahme	-	-1
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	36	51
Zurückgenommen	-93	-103
Nettoabnahme	-57	-52
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	5	6
Zurückgenommen	-19	-12
Nettoabnahme	-14	-6
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	6	35
Zurückgenommen	-21	-33
Nettozunahme/-abnahme	-15	2
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	80	43
Zurückgenommen	-94	-44
Nettoabnahme	-14	-1
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	-	1
Zurückgenommen	-	-1
Nettozunahme	-	-
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	4	2
Zurückgenommen	-5	-5
Nettoabnahme	-1	-3
Klasse A GBP, thesaurierend		
Zurückgenommen	-	-1
Nettoabnahme	-	-1
Klasse A HKD, thesaurierend		
Zurückgenommen	-4	-2
Nettoabnahme	-4	-2
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	1
Zurückgenommen	-3	-1
Nettozunahme	1	-
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3.216	83
Zurückgenommen	-840	-551
Nettozunahme/-abnahme	2.376	-468
Klasse B USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	-	-1
Nettoabnahme	-	-1

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
Klasse B USD, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-	-3
Nettoabnahme	-	-3
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	3	1
Zurückgenommen	-7	-10
Nettoabnahme	-4	-9
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-8	-10
Nettoabnahme	-7	-9
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	-	2
Zurückgenommen	-7	-25
Nettoabnahme	-7	-23
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-2	-
Nettoabnahme	-2	-
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	3	6
Zurückgenommen	-11	-10
Nettoabnahme	-8	-4
Klasse F USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	-	1
Zurückgenommen	-5	-4
Nettoabnahme	-5	-3
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	1	8
Zurückgenommen	-6	-15
Nettoabnahme	-5	-7
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-	-1
Nettoabnahme	-	-1
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	-	4
Zurückgenommen	-4	-4
Nettoabnahme	-4	-
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	13	3
Zurückgenommen	-18	-24
Nettoabnahme	-5	-21
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	8	40
Zurückgenommen	-70	-718
Nettoabnahme	-62	-678
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	-
Nettozunahme	1	-
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	-	1
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	-2	-
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	-
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Zurückgenommen	-	-1
Nettoabnahme	-	-1
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	10	5
Zurückgenommen	-52	-56
Nettoabnahme	-42	-51
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	-	-33
Nettoabnahme	-	-33
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Zurückgenommen	-2	-
Nettoabnahme	-2	-
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	1	6
Zurückgenommen	-8	-13
Nettoabnahme	-7	-7

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)					
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-3	-3			
Nettoabnahme	-3	-3			
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	4	21			
Zurückgenommen	-22	-11			
Nettozunahme/-abnahme	-18	10			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Zurückgenommen	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	3	15			
Zurückgenommen	-14	-9			
Nettozunahme/-abnahme	-11	6			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	-	15			
Zurückgenommen	-4	-16			
Nettoabnahme	-4	-1			
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-1	-4			
Nettoabnahme	-	-3			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-2	-5			
Nettoabnahme	-1	-4			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	-	3			
Zurückgenommen	-4	-3			
Nettoabnahme	-4	-			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	1	3			
Zurückgenommen	-5	-55			
Nettoabnahme	-4	-52			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	324	1.444			
Zurückgenommen	-1.019	-1.127			
Nettozunahme/-abnahme	-695	317			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	16	6			
Zurückgenommen	-37	-15			
Nettoabnahme	-21	-9			
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	135	96			
Zurückgenommen	-166	-72			
Nettozunahme/-abnahme	-31	24			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	17	27			
Zurückgenommen	-25	-23			
Nettozunahme/-abnahme	-8	4			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	39	66			
Zurückgenommen	-65	-160			
Nettoabnahme	-26	-94			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	12	50			
Zurückgenommen	-14	-1			
Nettozunahme/-abnahme	-2	49			
Klasse A SEK, thesaurierend					
Verkauft	88	120			
Zurückgenommen	-450	-416			
Nettoabnahme	-362	-296			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	-	16			
Zurückgenommen	-20	-15			
Nettozunahme/-abnahme	-20	1			
Klasse X USD, thesaurierend					
Verkauft	25	55			
Zurückgenommen	-97	-100			
Nettoabnahme	-72	-45			
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	2			
Zurückgenommen	-4	-4			
Nettoabnahme	-3	-2			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	38	17			
Zurückgenommen	-23	-11			
Nettozunahme	15	6			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	53	-			
Zurückgenommen	-8	-1			
Nettozunahme/-abnahme	45	-1			
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	4	14			
Zurückgenommen	-14	-12			
Nettozunahme/-abnahme	-10	2			
Klasse X GBP, thesaurierend					
Verkauft	536	1.317			
Zurückgenommen	-1.245	-547			
Nettozunahme/-abnahme	-709	770			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	224	342			
Zurückgenommen	-311	-781			
Nettoabnahme	-87	-439			
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	-	8			
Zurückgenommen	-117	-6			
Nettozunahme/-abnahme	-117	2			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	2	31			
Zurückgenommen	-16	-14			
Nettozunahme/-abnahme	-14	17			
Klasse Premier GBP, thesaurierend					
Verkauft	64	73			
Zurückgenommen	-42	-55			
Nettozunahme	22	18			
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft	1.582	2.151			
Zurückgenommen	-2.199	-2.265			
Nettoabnahme	-617	-114			
S Klasse EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	4	6			
Zurückgenommen	-5	-43			
Nettoabnahme	-1	-37			
Klasse S EUR, thesaurierend					
Verkauft	187	-			
Zurückgenommen	-75	-			
Nettozunahme	112	-			
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	40	118			
Zurückgenommen	-186	-55			
Nettozunahme/-abnahme	-146	63			
Klasse S GBP, thesaurierend					
Verkauft	144	339			
Zurückgenommen	-516	-355			
Nettoabnahme	-372	-16			
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)					
Verkauft	49	24			
Zurückgenommen	-27	-44			
Nettozunahme/-abnahme	22	-20			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Verkauft	37	138			
Zurückgenommen	-61	-7			
Nettozunahme/-abnahme	-24	131			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^A					
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	14	16			
Zurückgenommen	-14	-27			
Nettoabnahme	-	-11			
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^A					
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1.469	9.720			
Zurückgenommen	-3.033	-9.793			
Nettoabnahme	-1.564	-73			
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	206	3.013			
Zurückgenommen	-1.432	-3.756			
Nettoabnahme	-1.226	-743			
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	1.143	4.500			
Zurückgenommen	-1.908	-5.071			
Nettoabnahme	-765	-571			
Klasse A USD, ausschüttend (Q)					
Verkauft	42	95			
Zurückgenommen	-89	-111			
Nettoabnahme	-47	-16			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	128	711			
Zurückgenommen	-111	-1.182			
Nettozunahme/-abnahme	17	-471			
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft	10.144	16.667			
Zurückgenommen	-6.620	-5.439			
Nettozunahme	3.524	11.228			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)					
Verkauft	71	406			
Zurückgenommen	-360	-288			
Nettozunahme/-abnahme	-289	118			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	4.494	7.976			
Zurückgenommen	-6.167	-3.080			
Nettozunahme/-abnahme	-1.673	4.896			
Klasse A EUR, ausschüttend (A)					
Verkauft	17	45			
Zurückgenommen	-17	-			
Nettozunahme	-	45			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	150	290			
Zurückgenommen	-168	-185			
Nettozunahme/-abnahme	-18	105			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	2.945	8.620			
Zurückgenommen	-2.177	-8.849			
Nettozunahme/-abnahme	768	-229			
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	36	64			
Zurückgenommen	-68	-16			
Nettozunahme/-abnahme	-32	48			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	140	57			
Zurückgenommen	-327	-95			
Nettoabnahme	-187	-38			
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	14	213			
Zurückgenommen	-124	-93			
Nettozunahme/-abnahme	-110	120			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	53	228			
Zurückgenommen	-222	-375			
Nettoabnahme	-169	-147			
Klasse E EUR, thesaurierend					
Verkauft	12	-			
Zurückgenommen	-3	-			
Nettozunahme	9	-			
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			50	556	
Zurückgenommen			-371	-54	
Nettozunahme/-abnahme			-321	502	
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft			182	448	
Zurückgenommen			-194	-186	
Nettozunahme/-abnahme			-12	262	
Klasse U EUR, thesaurierend					
Verkauft			7.090	-	
Zurückgenommen			-2.566	-	
Nettozunahme			4.524	-	
Klasse X USD, thesaurierend					
Verkauft			28	128	
Zurückgenommen			-137	-4	
Nettozunahme/-abnahme			-109	124	
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Verkauft			42	8	
Zurückgenommen			-54	-5	
Nettozunahme/-abnahme			-12	3	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)					
Verkauft			641	969	
Zurückgenommen			-1.363	-318	
Nettozunahme/-abnahme			-722	651	
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft			1.200	3.299	
Zurückgenommen			-3.580	-1.267	
Nettozunahme/-abnahme			-2.380	2.032	
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)					
Verkauft			-	42	
Zurückgenommen			-34	-75	
Nettoabnahme			-34	-33	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)					
Verkauft			69	89	
Zurückgenommen			-120	-21	
Nettozunahme/-abnahme			-51	68	
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft			718	9.228	
Zurückgenommen			-3.209	-5.090	
Nettozunahme/-abnahme			-2.491	4.138	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			-	567	
Zurückgenommen			-485	-1.620	
Nettoabnahme			-485	-1.053	
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)					
Verkauft			169	133	
Zurückgenommen			-810	-656	
Nettoabnahme			-641	-523	
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)					
Verkauft			-	14	
Zurückgenommen			-	-825	
Nettoabnahme			-	-811	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)					
Verkauft			926	26	
Zurückgenommen			-642	-297	
Nettozunahme/-abnahme			284	-271	
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft			7.787	12.764	
Zurückgenommen			-12.493	-3.585	
Nettozunahme/-abnahme			-4.706	9.179	
Klasse Premier GBP, thesaurierend					
Verkauft			12	13	
Zurückgenommen			-27	-355	
Nettoabnahme			-15	-342	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)					
Verkauft			14	360	
Zurückgenommen			-458	-586	
Nettoabnahme			-444	-226	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)					
Verkauft			1.501	2.346	
Zurückgenommen			-2.586	-2.310	
Nettozunahme/-abnahme			-1.085	36	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^A					
Klasse A USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-3			
Nettoabnahme	–	-3			
Klasse A USD, ausschüttend (Q)					
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-2			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-7			
Nettoabnahme	–	-7			
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)					
Zurückgenommen	–	-7			
Nettoabnahme	–	-7			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-9			
Nettoabnahme	–	-9			
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	15	203			
Zurückgenommen	-92	-92			
Nettozunahme/-abnahme	-77	111			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	48	187			
Zurückgenommen	-201	-224			
Nettoabnahme	-153	-37			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	48	543			
Zurückgenommen	-200	-143			
Nettozunahme/-abnahme	-152	400			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	8	100			
Zurückgenommen	-36	-36			
Nettozunahme/-abnahme	-28	64			
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft	58	97			
Zurückgenommen	-29	-12			
Nettozunahme	29	85			
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)					
Verkauft	–	1			
Nettozunahme	–	1			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	12	64			
Zurückgenommen	-18	-9			
Nettozunahme/-abnahme	-6	55			
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	4	50			
Zurückgenommen	-6	-3			
Nettozunahme/-abnahme	-2	47			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	–	63			
Zurückgenommen	-54	-81			
Nettoabnahme	-54	-18			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	11.949	98.637			
Zurückgenommen	-24.627	-38.661			
Nettozunahme/-abnahme	-12.678	59.976			
Klasse U USD, thesaurierend					
Verkauft	128	48			
Zurückgenommen	-68	–			
Nettozunahme	60	48			
Klasse U USD, ausschüttend (Q) Plus (e)					
Verkauft	61	–			
Zurückgenommen	-13	–			
Nettozunahme	48	–			
Klasse U EUR, thesaurierend					
Verkauft	12	86			
Zurückgenommen	-67	–			
Nettozunahme/-abnahme	-55	86			
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-2	–			
Nettozunahme/-abnahme	-1	1			
Klasse U GBP thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	2	–			
Nettozunahme	2	–			
Klasse A GBP, thesaurierend					
Verkauft	10	27			
Zurückgenommen	-7	–			
Nettozunahme	3	27			
Klasse U GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	4	–			
Zurückgenommen	-2	–			
Nettozunahme	2	–			
Klasse U GBP, ausschüttend (Q) Plus (e)					
Verkauft	7	–			
Zurückgenommen	-1	–			
Nettozunahme	6	–			
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	65	577			
Zurückgenommen	-237	-395			
Nettozunahme/-abnahme	-172	182			
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	–	5			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettozunahme/-abnahme	-1	4			
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	7	23			
Zurückgenommen	-22	-4			
Nettozunahme/-abnahme	-15	19			
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	1	9			
Zurückgenommen	-5	-4			
Nettozunahme/-abnahme	-4	5			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	5	97			
Zurückgenommen	-9	-116			
Nettoabnahme	-4	-19			
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	216	1.047			
Zurückgenommen	-155	-438			
Nettozunahme	61	609			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	61	367			
Zurückgenommen	-106	-25			
Nettozunahme/-abnahme	-45	342			
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft	67	322			
Zurückgenommen	-56	-43			
Nettozunahme	11	279			
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	9	101			
Zurückgenommen	-33	-30			
Nettozunahme/-abnahme	-24	71			
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^Aη					
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	14	–			
Nettozunahme	14	–			
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft	50	–			
Nettozunahme	50	–			
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	161	118			
Zurückgenommen	-176	-244			
Nettoabnahme	-15	-126			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	5	5			
Zurückgenommen	-9	-10			
Nettoabnahme	-4	-5			
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	24	34			
Zurückgenommen	-28	-36			
Nettoabnahme	-4	-2			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)					
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	158	54			
Zurückgenommen	-129	-42			
Nettozunahme	29	12			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	30	61			
Zurückgenommen	-60	-53			
Nettozunahme/-abnahme	-30	8			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	39	41			
Zurückgenommen	-51	-74			
Nettoabnahme	-12	-33			
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft	1	5			
Zurückgenommen	-1	-6			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-1	-2			
Nettoabnahme	-1	-2			
Klasse A GBP ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	2	15			
Zurückgenommen	-3	-15			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	8.696	3.936			
Zurückgenommen	-4.281	-3.306			
Nettozunahme	4.415	630			
Klasse A SGD, thesaurierend					
Verkauft	1.913	857			
Zurückgenommen	-4.463	-914			
Nettoabnahme	-2.550	-57			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	10	9			
Zurückgenommen	-17	-13			
Nettoabnahme	-7	-4			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	2	1			
Zurückgenommen	-2	-1			
Nettozunahme	-	-			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	24	13			
Zurückgenommen	-23	-16			
Nettozunahme/-abnahme	1	-3			
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	12	2			
Zurückgenommen	-3	-1			
Nettozunahme	9	1			
Klasse E EUR, thesaurierend					
Verkauft	5	3			
Zurückgenommen	-2	-2			
Nettozunahme	3	1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	2	5			
Zurückgenommen	-18	-37			
Nettoabnahme	-16	-32			
Klasse R EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	-			
Zurückgenommen	-1	-			
Nettozunahme	-	-			
Klasse X USD, thesaurierend					
Verkauft	123	149			
Zurückgenommen	-103	-93			
Nettozunahme	20	56			
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-	-2			
Nettoabnahme	-	-2			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	57	87			
Zurückgenommen	-52	-130			
Nettozunahme/-abnahme	5	-43			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	40	14			
Zurückgenommen	-18	-54			
Nettozunahme/-abnahme	22	-40			
Klasse X GBP, thesaurierend					
Verkauft	17	34			
Zurückgenommen	-32	-37			
Nettoabnahme	-15	-3			
Klasse X GBP ausschüttend (A)					
Verkauft	1	3			
Zurückgenommen	-3	-5			
Nettoabnahme	-2	-2			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	244	172			
Zurückgenommen	-419	-253			
Nettoabnahme	-175	-81			
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-60	-338			
Nettoabnahme	-60	-338			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	58	27			
Zurückgenommen	-22	-7			
Nettozunahme	36	20			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	38	68			
Zurückgenommen	-59	-97			
Nettoabnahme	-21	-29			
Klasse Premier GBP, thesaurierend					
Verkauft	56	22			
Zurückgenommen	-94	-73			
Nettoabnahme	-38	-51			
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	97	10			
Zurückgenommen	-8	-48			
Nettozunahme/-abnahme	89	-38			
FTGF Royce US Smaller Companies Fund					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	43	13			
Zurückgenommen	-42	-33			
Nettozunahme/-abnahme	1	-20			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	4	3			
Zurückgenommen	-7	-7			
Nettoabnahme	-3	-4			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-	-1			
Nettozunahme	-	-			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	2	2			
Zurückgenommen	-4	-2			
Nettoabnahme	-2	-			
Klasse A EUR, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	-			
Nettozunahme	1	-			
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	5			
Zurückgenommen	-1	-5			
Nettozunahme	-	-			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-1	-2			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	1	-			
Zurückgenommen	-1	-			
Nettozunahme	-	-			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	15	7			
Zurückgenommen	-5	-6			
Nettozunahme	10	1			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund – (Fortsetzung)					
Klasse F USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	–			
Zurückgenommen	-1	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse R USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse X USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-2			
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	–			
Zurückgenommen	-1	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	37	–			
Zurückgenommen	-8	-1			
Nettozunahme/-abnahme	29	-1			
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	4	4			
Zurückgenommen	-10	-14			
Nettoabnahme	-6	-10			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)					
Verkauft	2	–			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettozunahme/-abnahme	1	-1			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	-2	-1			
Nettoabnahme	-2	-1			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-2			
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^A					
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	–	-10			
Nettoabnahme	–	-9			
Klasse A USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-7			
Nettoabnahme	–	-7			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	–	-5			
Nettoabnahme	–	-5			
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Zurückgenommen	–	-48			
Nettoabnahme	–	-48			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Zurückgenommen	–	-23			
Nettoabnahme	–	-23			
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Zurückgenommen	–	-11			
Nettoabnahme	–	-11			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-2			
Klasse A EUR, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus					
Zurückgenommen	–	-4			
Nettoabnahme	–	-4			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	–	41			
Zurückgenommen	–	-431			
Nettoabnahme	–	-390			
Klasse C USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-2			
Nettoabnahme	–	-2			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	–	-8			
Nettoabnahme	–	-8			
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-3			
Nettoabnahme	–	-3			
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	–	-18			
Nettoabnahme	–	-18			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-15			
Nettoabnahme	–	-15			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-10			
Nettoabnahme	–	-10			
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse GA USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-5			
Nettoabnahme	–	-5			
Klasse GA EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-62			
Nettoabnahme	–	-62			
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^A					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	–	5			
Zurückgenommen	-12	-6			
Nettoabnahme	-12	-1			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	2			
Zurückgenommen	-13	-2			
Nettoabnahme	-13	–			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	–	4			
Zurückgenommen	-38	-6			
Nettoabnahme	-38	-2			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	–	54			
Zurückgenommen	-45	-39			
Nettozunahme/-abnahme	-45	15			
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft	–	16			
Zurückgenommen	-16	-16			
Nettoabnahme	-16	–			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Zurückgenommen	-1	-3			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	–	2			
Zurückgenommen	-139	-29			
Nettoabnahme	-139	-27			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	–	21			
Zurückgenommen	-48	-15			
Nettozunahme/-abnahme	-48	6			
Klasse C USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)		29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^{αδ} – (Fortsetzung)					
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-6	-2			
Nettoabnahme	-6	-1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Zurückgenommen	-2	–			
Nettozunahme/-abnahme	-2	2			
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-1	-66			
Nettoabnahme	-1	-65			
Klasse GA USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-45	-1			
Nettoabnahme	-45	-1			
Klasse GA EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse GE USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-4	–			
Nettoabnahme	-4	–			
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α					
Klasse A USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-12			
Nettoabnahme	–	-12			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Zurückgenommen	–	-3			
Nettoabnahme	–	-3			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Zurückgenommen	–	-6			
Nettoabnahme	–	-6			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Zurückgenommen	–	-13			
Nettoabnahme	–	-13			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	–	-69			
Nettoabnahme	–	-68			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-25			
Nettoabnahme	–	-25			
Klasse GA USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-20			
Nettoabnahme	–	-20			
Klasse GA EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-5			
Nettoabnahme	–	-5			
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse GE EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^{αβ}					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	–	4			
Zurückgenommen	-1	-3			
Nettozunahme/-abnahme	-1	1			
Klasse M GBP, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	3			
Zurückgenommen	-85	-16			
Nettoabnahme	-85	-13			
Klasse M USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	-26	–			
Nettozunahme/-abnahme	-26	1			
Klasse M EUR, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-4	–			
Nettoabnahme	-4	–			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	–	15			
Zurückgenommen	-15	-131			
Nettoabnahme	-15	-116			
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^α					
Klasse A USD, thesaurierend					
Verkauft	5	8			
Zurückgenommen	-10	-13			
Nettoabnahme	-5	-5			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	–			
Zurückgenommen	-1	-52			
Nettoabnahme	–	-52			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	26			
Zurückgenommen	-11	-11			
Nettozunahme/-abnahme	-10	15			
Klasse C USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	5	1			
Zurückgenommen	-13	-11			
Nettoabnahme	-8	-10			
Klasse F USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	–			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse X USD, thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Zurückgenommen	–	-1			
Nettozunahme	–	–			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Nettozunahme	–	1			
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	5	6			
Zurückgenommen	-4	-2			
Nettozunahme	1	4			
Klasse X GBP, thesaurierend					
Verkauft	5	1			
Zurückgenommen	-5	-1			
Nettozunahme	–	–			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	5	54			
Zurückgenommen	-21	-161			
Nettoabnahme	-16	-107			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-3	–			
Nettoabnahme	-3	–			
Klasse S USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-63	-8			
Nettoabnahme	-63	-8			
S Klasse EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	207	616			
Zurückgenommen	-523	-294			
Nettozunahme/-abnahme	-316	322			
Klasse S GBP, thesaurierend					
Verkauft	54	2			
Zurückgenommen	-67	-18			
Nettoabnahme	-13	-16			
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund					
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	3	3			
Zurückgenommen	-15	–			
Nettozunahme/-abnahme	-12	3			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	19	48			
Zurückgenommen	-18	-53			
Nettozunahme/-abnahme	1	-5			
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Zurückgenommen	-6	-2			
Nettoabnahme	-6	-2			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Zurückgenommen	-89	-807
Nettoabnahme	-89	-807
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	-	2
Zurückgenommen	-10	-
Nettozunahme/-abnahme	-10	2
Klasse D USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	-12	-
Nettoabnahme	-12	-
Klasse X AUD, thesaurierend		
Verkauft	-	1
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	-2	-
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	-	3
Zurückgenommen	-1	-2
Nettozunahme/-abnahme	-1	1
Klasse LM AUD, thesaurierend		
Zurückgenommen	-	-5
Nettoabnahme	-	-5
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	15	21
Zurückgenommen	-20	-35
Nettoabnahme	-5	-14
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	-	2
Zurückgenommen	-2	-1
Nettozunahme/-abnahme	-2	1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	21	81
Zurückgenommen	-29	-36
Nettozunahme/-abnahme	-8	45
Klasse X USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	-	-6
Nettoabnahme	-	-6
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	-	26
Zurückgenommen	-20	-44
Nettoabnahme	-20	-18
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-2	-14
Nettoabnahme	-1	-13
Klasse S EUR, thesaurierend		
Verkauft	-	1
Zurückgenommen	-	-45
Nettoabnahme	-	-44
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	-	-1
Nettoabnahme	-	-1
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	10
Zurückgenommen	-3	-44
Nettoabnahme	-1	-34
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	-	-1
Nettoabnahme	-	-1
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	3	3
Zurückgenommen	-3	-11
Nettoabnahme	-	-8
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	15	-
Zurückgenommen	-58	-115
Nettoabnahme	-43	-115
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	7
Zurückgenommen	-1	-170
Nettoabnahme	-	-163

	Für das Geschäftsjahr zum	
	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	-	5
Zurückgenommen	-	-5
Nettozunahme	-	-
Klasse S EUR, thesaurierend		
Verkauft	40	113
Zurückgenommen	-85	-567
Nettoabnahme	-45	-454
Klasse S GBP, thesaurierend		
Verkauft	76	136
Zurückgenommen	-361	-142
Nettoabnahme	-285	-6
FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]γ		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	1	-
Nettozunahme	1	-
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	10	-
Zurückgenommen	-3	-
Nettozunahme	7	-
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	47	-
Nettozunahme	47	-
S Klasse EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	-
Nettozunahme	1	-
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	-
Nettozunahme	4	-
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	123	1
Zurückgenommen	-27	-
Nettozunahme	96	1
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus		
Verkauft	-	1
Zurückgenommen	-1	-
Nettozunahme/-abnahme	-1	1
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	413	52
Zurückgenommen	-32	-1
Nettozunahme	381	51
Klasse D EUR, thesaurierend		
Verkauft	15	1
Zurückgenommen	-5	-
Nettozunahme	10	1
Klasse D EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	-1	-
Nettozunahme	1	1
Klasse K EUR, thesaurierend		
Verkauft	-	1
Zurückgenommen	-1	-
Nettozunahme/-abnahme	-1	1
Klasse K EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	-	1
Zurückgenommen	-1	-
Nettozunahme/-abnahme	-1	1
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	5	97
Zurückgenommen	-97	-
Nettozunahme/-abnahme	-92	97
Klasse X EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	201	221
Zurückgenommen	-128	-
Nettozunahme	73	221

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

- Mit „–“ angegebene Beträge belaufen sich auf 0 oder auf weniger als 1.000. Es sind nur Klassen angegeben, bei denen im Geschäftsjahr Transaktionen erfolgt sind.
- α Mit Wirkung vom 24. März 2023 haben der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] den Handel eingestellt.
- β Mit Wirkung vom 20. April 2023 hat der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] den Handel eingestellt.
- γ Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 hat der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel aufgenommen.
- δ Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 hat der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] den Handel eingestellt.
- η Mit Wirkung vom 22. September 2023 hat der FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^] den Handel aufgenommen.
- θ Mit Wirkung vom 23. Oktober 2023 hat der FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] den Handel eingestellt.
- λ Mit Wirkung vom 6. November 2023 hat der FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^] den Handel aufgenommen.
- μ Mit Wirkung vom 10. November 2023 hat der FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.
- ¥ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2023 hat der FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.
- [^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss

1. Allgemeines

Franklin Templeton Global Funds plc (die „Gesellschaft“) ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, die nach irischem Recht als Aktiengesellschaft gemäß dem Companies Act von 2014, den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 in der jeweils gültigen Fassung (die „UCITS Regulations“) und den OGAW-Bestimmungen der Zentralbank gegründet wurde. Diese wurde am 13. Januar 1998 unter der Registernummer 278601 eingetragen.

Ihr Zweck gemäß ihren Gründungsdokumenten ist die gemeinsame Anlage von öffentlich beschafftem Kapital in übertragbaren Wertpapieren und anderen liquiden Finanzanlagen nach dem Grundsatz der Risikostreuung. Die Gesellschaft ist in Form eines Umbrella-Fonds organisiert. Die konstituierenden Dokumente der Gesellschaft sehen vor, dass die Gesellschaft separate Anteilsklassen anbieten kann, die jeweils Anteile an einem Teilfonds (der „Fonds“ bzw. zusammen die „Fonds“) repräsentieren, der jeweils ein eigenes Anlagenportfolio besitzt. Ein gesondertes Portfolio von Vermögenswerten für eine Anteilsklasse wird nicht geführt. Die von der Gesellschaft aufgelegten Fonds sind im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ dieses Berichts aufgeführt. Das Hauptanlageziel und die Anlagerichtlinien aller Fonds sind im entsprechenden Nachtrag zum Verkaufsprospekt dargelegt.

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

Die zur Erstellung des Abschlusses von der Gesellschaft angewendeten Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind unten dargelegt.

Übereinstimmungserklärung

Der Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 wurde im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen einschließlich des Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and the Republic of Ireland“ („FRS 102“) und irischem Recht einschließlich des Companies Act 2014, der OGAW-Vorschriften und der OGAW-Bestimmungen der Zentralbank erstellt. Diese Regelungen entsprechen denjenigen, die bei der Erstellung des Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 angewendet wurden.

Grundlage der Aufstellung

Der Abschluss wurde auf der Grundlage der Fortführung der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft nach dem Prinzip der historischen Kosten erstellt, das durch die Neubewertung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten werden, modifiziert wurde. Der Abschluss des Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund[^], Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], Legg Mason US Equity Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund[^], Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^], Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Japan Equity Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund[^] und Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^] wurde nach dem Prinzip der Nichtfortführung erstellt, da diese Fonds im laufenden und in früheren Geschäftsjahren oder nach dem Bilanzstichtag geschlossen wurden.

Das Format und bestimmte Formulierungen des Abschlusses wurden an die im Companies Act von 2014 enthaltenen angepasst, so dass sie nach Ansicht der Verwaltungsratsmitglieder die Art der Geschäftstätigkeiten als Investmentfonds besser widerspiegeln.

Die Gesellschaft hat von der Ausnahmeregelung, die offenen Anlagefonds gemäß Section 7 „Statement of Cash Flows“ [Kapitalflussrechnung] von FRS 102 eingeräumt wird, Gebrauch gemacht und keine Kapitalflussrechnung erstellt. Dies basiert darauf, dass im Wesentlichen alle Anlagen der Gesellschaft hochgradig liquide sind und zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden und die Gesellschaft eine Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, bereitstellt.

(a) Wertpapiere des Anlagevermögens zum beizulegenden Zeitwert

Die Gesellschaft hat alle Finanzinstrumente, einschließlich Anlagen in Schuldtiteln und Beteiligungspapieren, leerverkaufter Wertpapiere und damit verbundener Derivate, als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte bzw. finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Diese finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden als für Handelszwecke gehalten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden grundsätzlich gekauft oder eingegangen, um sie kurzfristig zu verkaufen oder zurückzukaufen. Derivate werden auch als zum Handel gehalten eingestuft, da die Gesellschaft keine Derivate als Sicherungsgeschäfte in einer Sicherungsbeziehung einstuft.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden anfänglich zu ihrem beizulegenden Zeitwert angesetzt. Transaktionskosten werden in der Gesamtergebnisrechnung als Aufwand verbucht. Nach dem erstmaligen Ansatz werden alle erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Gewinne und Verluste aus Änderungen des beizulegenden Zeitwerts der Kategorie „Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte oder finanzielle Verbindlichkeiten“ werden in der Gesamtergebnisrechnung in dem Geschäftsjahr ausgewiesen, in dem sie entstehen.

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (z. B. börsengehandelte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den Kursnotierungen am Bilanzstichtag. Von den Fonds gehaltene Finanzinstrumente (einschließlich Anleihen), die an einem regulierten Markt notiert sind oder gehandelt werden, werden auf der Grundlage des letzten verfügbaren Mittelkurses an dem betreffenden Handelstag bewertet. Der beizulegende Zeitwert von Organismen für gemeinsame Anlagen basiert auf dem gehandelten Nettoinventarwert des jeweiligen Fonds zum Bilanzstichtag, wie von der Verwaltungsstelle des Teilfonds mitgeteilt.

Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit in Finanzinstrumente investieren, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden (z. B. in außerbörsliche Derivate). Der beizulegende Zeitwert wird mithilfe von Bewertungsmethoden ermittelt. Die Gesellschaft wendet eine Vielzahl von Methoden an und trifft Annahmen, die auf den zum Bilanzstichtag herrschenden Marktbedingungen basieren. Zu den angewendeten Bewertungsmethoden gehören der Rückgriff auf vergleichbare aktuelle Transaktionen zu marktüblichen Bedingungen, diskontierte Cashflow-Analysen und andere Bewertungsmethoden, die üblicherweise von Marktteilnehmern angewendet werden. Die diesen Instrumenten zugewiesenen Werte basieren auf den besten verfügbaren Informationen. Aufgrund der Unsicherheit der Bewertung können diese Werte erheblich von den Werten abweichen, die erzielt worden wären, hätte es einen verfügbaren Markt für diese Instrumente gegeben. Diese Abweichungen können erheblich sein. Der Abschluss dieser Kontrakte beinhaltet in unterschiedlichem Maße Kredit-, Rechts-, Markt- und Dokumentationsrisiken, die über die in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Beträge hinausgehen. Solche Risiken beinhalten die Möglichkeit, dass es keinen liquiden Markt für diese Vereinbarungen geben wird, dass die Vertragspartner der Vereinbarungen ihren Verpflichtungen zur Erfüllung nicht nachkommen oder mit den vertraglichen Bedingungen in den Vereinbarungen nicht einverstanden sind oder dass es ungünstige Änderungen der Zinssätze oder des Preises des diesen Transaktionen zugrunde liegenden Index oder Wertpapiers geben kann. Die am Jahresende herangezogenen Preise, die von einer einzigen Broker-Quelle bezogen wurden oder auf Bewertungsmethoden basieren, sind die beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts zum Jahresende. Es besteht jedoch ein gewisses Maß an Unsicherheit hinsichtlich dieser Preise. Es ist möglicherweise nicht immer möglich, die Positionen zum angegebenen Marktwert mit der betreffenden Gegenpartei zu schließen.

(b) Ansatz/Ausbuchung

Reguläre Käufe und Verkäufe von Wertpapieren werden an dem einem Handelstag folgenden Tag ausgewiesen, d. h. zu dem Datum, an dem die Gesellschaft sich verpflichtet, das Wertpapier zu kaufen oder zu verkaufen. Wertpapiere werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert angesetzt, wobei die entstehenden Transaktionskosten sämtlicher Finanzanlagen, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden, sofort als Aufwand verbucht werden. Wertpapiere werden nicht mehr ausgewiesen, wenn der Anspruch auf Cashflows aus dem Wertpapier erloschen ist oder die Gesellschaft so gut wie alle Risiken und Erträge aus dem Besitz des Wertpapiers übertragen hat.

(c) Preissetzung durch einzelnen Broker

Die am Jahresende herangezogenen Preise, die von einer einzigen Broker-Quelle bezogen wurden, sind die beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts zum Jahresende. Es besteht jedoch ein gewisses Maß an Unsicherheit hinsichtlich dieser Preise. Es ist möglicherweise nicht immer möglich, die Positionen zum angegebenen Marktwert mit der betreffenden Gegenpartei zu schließen. Die Werte der Wertpapiere für die einzelnen Fonds, die zum 29. Februar 2024 und zum 28. Februar 2023 unter Verwendung von Einzelbroker-Quellen bewertet wurden, sind in Anhang 12.1 (d) dargelegt.

(d) Bilanzierung von Finanzanlagen

Wertpapiergeschäfte werden am Abwicklungstag +1 gebucht. Finanzanlagen werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert angesetzt, wobei die entstehenden Transaktionskosten sämtlicher Wertpapiere, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden, sofort als Aufwand verbucht werden. Gewinne oder Verluste beim Verkauf von Wertpapieren werden nach der First-In-First-Out-Methode („FIFO“) berechnet.

(e) Erträge aus Anlagen

In der Gesamtergebnisrechnung werden Zinserträge und -aufwendungen für alle Schuldtitel nach der Effektivzinismethode ausgewiesen. Die Anlageverwalter überwachen ausstehende Zinserträge für sämtliche rückständigen Zinsforderungen. Die Konten wurden auf rückständige Zinsforderungen geprüft. Zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 wurden sämtliche Beträge als einbringbar ausgewiesen.

Dividenden werden am Tag des Dividendenabschlags in der Gesamtergebnisrechnung verbucht, wenn das jeweilige Wertpapier „ex-Dividende“ notiert. Dividenerträge werden einschließlich nicht rückerstattungsfähiger Quellensteuern, die getrennt in der Gesamtergebnisrechnung erscheinen, ausgewiesen.

(f) Aufrechnung von Finanzinstrumenten

Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten werden miteinander saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, falls es ein einklagbares Recht gibt, die anerkannten Beträge miteinander zu saldieren, und falls die Absicht besteht, auf Nettobasis abzuschließen, oder die Aktiva zu realisieren (verkaufen) und gleichzeitig einen Ausgleich für die Verbindlichkeiten zu finden. Zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 lag keine Saldierung von Finanzinstrumenten vor.

(g) Wichtige rechnungslegungsbezogene Schätzungen und Annahmen

Der Anlageverwalter unternimmt künftige Schätzungen und formuliert entsprechende Annahmen. Die daraus resultierenden rechnungslegungsbezogenen Schätzungen entsprechen naturgemäß nur selten den tatsächlichen Ergebnissen. Nachfolgend sind jene Schätzungen und Annahmen aufgeführt, die höchstwahrscheinlich eine erhebliche Anpassung des Buchwerts der Aktiva und Passiva im nächsten Berichtszeitraum bewirken werden.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden – (Fortsetzung)

(g) Wichtige rechnungslegungsbezogene Schätzungen und Annahmen – (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzderivaten

Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit Finanzinstrumente halten, die nicht an aktiven Märkten notiert sind, wie OTC-Derivate. Die beizulegenden Zeitwerte dieser Instrumente werden mithilfe von Bewertungsmethoden, wie in Anhang 2(a) beschrieben, ermittelt. Werden Bewertungsmethoden (z. B. Modelle) zur Ermittlung der beizulegenden Zeitwerte herangezogen, werden diese validiert und regelmäßig überprüft und mit dem Preis verglichen, der von einem unabhängigen Preisdienstleister bereitgestellt wird, sofern verfügbar.

Modelle verwenden nach Möglichkeit beobachtbare Daten. In Bereichen wie Kreditrisiko (sowohl das eigene als auch das der Gegenpartei), Volatilitäten und Korrelationen muss das Management jedoch Schätzungen vornehmen. Änderungen der Annahmen über diese Faktoren können sich auf den ausgewiesenen beizulegenden Zeitwert von Finanzinstrumenten auswirken.

Die diesen Instrumenten zugewiesenen Werte basieren auf den besten verfügbaren Informationen. Aufgrund der Unsicherheit der Bewertung können diese Werte erheblich von den Werten abweichen, die erzielt worden wären, hätte es einen verfügbaren Markt für diese Instrumente gegeben. Diese Abweichungen können erheblich sein. Der Abschluss dieser Kontrakte beinhaltet in unterschiedlichem Maße Kredit-, Rechts-, Markt- und Dokumentationsrisiken, die über die in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Beträge hinausgehen. Solche Risiken beinhalten die Möglichkeit, dass es keinen liquiden Markt für diese Vereinbarungen geben wird, dass die Vertragspartner der Vereinbarungen ihren Verpflichtungen zur Erfüllung nicht nachkommen oder mit den vertraglichen Bedingungen in den Vereinbarungen nicht einverstanden sind oder dass es ungünstige Änderungen der Zinssätze oder des Preises des diesen Transaktionen zugrunde liegenden Index oder Wertpapiers geben kann.

(h) Wertpapierleihe

Bestimmte Fonds können Wertpapiere an Broker, Händler und andere Finanzorganisationen verleihen, um zusätzliche Einnahmen zu erzielen. Jede Wertpapierleihe ist durch Sicherheiten abgesichert, die mindestens dem aktuellen Marktwert der verliehenen Wertpapiere entsprechen. Bei einem finanziellen Ausfall des Kreditnehmers besteht das Risiko einer Verzögerung beim Erhalt der Sicherheiten oder der Rückforderung der verliehenen Wertpapiere oder sogar eines Verlusts der Sicherheiten.

Zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 waren keine Fonds an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

(i) Ausgleich

Eine Ausgleichsrechnung wird vorgenommen, so dass Ausschüttungen für alle Anteile derselben Art gleich hoch sind, ungeachtet der unterschiedlichen Ausgabedaten. Ertrags- und Aufwandsausgleich werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

Ertragsausgleich

Eine dem Ausgabepreis des Anteils entsprechende Summe, die die ggf. aufgelaufenen und noch nicht ausgeschütteten Erträge bis zum Datum der Emission darstellt, wird als Ausgleichszahlung durch die Anteilinhaber angesehen. Auf diese Weise soll dem Anteilinhaber ein Anrecht auf Dividenden ab dem Stichtag der Emission erteilt werden, sofern diese Daten in den Abrechnungszeitraum fallen.

Aufwandsausgleich

Eine dem Ausgabepreis des Anteils entsprechende Summe, die den ggf. aufgelaufenen und noch nicht ausgeschütteten Aufwand bis zum Datum der Emission darstellt, wird als Ausgleichszahlung angesehen. Auf diese Weise soll dem Anteilinhaber ein Anrecht auf Dividenden ab dem Stichtag der Emission erteilt werden, sofern diese Daten in den Abrechnungszeitraum fallen.

(j) Aufwendungen

Die Ausgaben werden periodengerecht abgegrenzt. Bestimmte Aufwendungen gelten nur für eine bestimmte Anteilsklasse und werden daher direkt dieser Anteilsklasse belastet. Die allgemeinen Aufwendungen des Fonds werden den verschiedenen Anteilsklassen auf der Basis des relativen Nettoinventarwerts zugerechnet.

(k) Transaktionskosten

Transaktionskosten sind zusätzliche Kosten, die unmittelbar dem Erwerb, der Emission oder der Veräußerung eines finanziellen Vermögenswertes oder einer finanziellen Verbindlichkeit zurechenbar sind. Zusätzliche Kosten sind solche, die nicht entstanden wären, wenn das Finanzinstrument nicht erworben, begeben oder veräußert worden wäre. Bei der erstmaligen Erfassung von finanziellen Vermögenswerten oder finanziellen Verbindlichkeiten sind diese erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu erfassen, wobei die Transaktionskosten unmittelbar in der Gesamtergebnisrechnung erfasst werden.

Die von der Verwahrstelle bei der Abrechnung von Käufen und Verkäufen von Anlagen erhobenen Transaktionskosten werden in der Gesamtergebnisrechnung für jeden Fonds in den Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren ausgewiesen.

Die Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe von Wertpapieren, Organismen für gemeinsame Anlagen, Futures-Kontrakten und Optionen werden in Erläuterung 4 für jeden Fonds ausgewiesen.

Die Transaktionskosten beim Kauf und Verkauf von Anleihen und sonstigen Devisenterminkontrakten sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Diese Kosten können nicht praktisch oder zuverlässig erfasst werden, da sie in den Kosten der Anlage eingepreist sind und nicht separat geprüft oder ausgewiesen werden können.

(l) Währungsumrechnung

- Leit- und Darstellungswährung: Alle Posten, die im Abschluss der Gesellschaft ausgewiesen sind, werden in der Währung ihres primären wirtschaftlichen Umfelds (die „Leitwährung“) bewertet. Bei allen Fonds mit Ausnahme des FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], deren Leitwährung der Euro ist, des FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], dessen Leitwährung das Pfund Sterling (britisches Pfund) ist, und des Legg Mason Japan Equity Fund[^], dessen Leitwährung der japanische Yen ist, ist der US-Dollar. Die Gesellschaft hat die Leitwährung jedes Fonds als Darstellungswährung für diesen Abschluss übernommen. Der Abschluss der Gesellschaft wird in US-Dollar dargestellt.
- Käufe und Verkäufe von Wertpapieren sowie Erträge und Aufwendungen werden zu dem Wechselkurs umgerechnet, der am Buchungsdatum der betreffenden Transaktion gilt. Aktiva und Passiva werden zu dem am Ende des Geschäftsjahres geltenden Wechselkurs umgerechnet. Differenzen zwischen ausgewiesenen und eingenommenen oder gezahlten Ertrags- und Aufwandsbeträgen werden in der Gesamtergebnisrechnung unter dem Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten als Wechselkursgewinne/-verluste erfasst.

(m) Devisentermin- und Kassadevisengeschäfte

Ein Devisenterminkontrakt (nachstehend „Forward-Kontrakt“ genannt) ist eine Verpflichtung zum Kauf oder Verkauf einer Fremdwährung an einem in der Zukunft liegenden Termin zu einem ausgehandelten Wechselkurs. Mit Forward-Kontrakten sollen Wechselkursrisiken kontrolliert und das Währungsrisiko des Portfolios taktisch verlagert werden. Forward-Kontrakte werden in der Regel als Absicherung beim Kauf oder Verkauf eines auf eine ausländische Währung lautenden Wertpapiers abgeschlossen. Nach dem Abschluss bzw. der Glatstellung des Forward-Kontrakts realisiert der Fonds einen Gewinn oder Verlust. Die nicht realisierten Wertsteigerungen oder Wertminderungen von Terminkontrakten werden in der Bilanz und Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen. Realisierte Gewinne und Verluste werden zusammen mit allen anderen Fremdwährungsgewinnen und -verlusten in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen. Forward-Kontrakte beinhalten unter anderem das Risiko, dass die Gegenpartei die Bedingungen des Kontrakts eventuell nicht erfüllen kann oder dass der Wert einer Währung gegenüber der Basiswährung des Fonds unerwartet schwankt. Der beizulegende Zeitwert von Forward-Kontrakten wird von einer unabhängigen Quelle bestimmt, wobei der Preis herangezogen wird, zu dem ein neuer Forward-Kontrakt derselben Höhe und Fälligkeit abgeschlossen werden könnte. Für jeden relevanten Fonds sind Gewinne oder Verluste aus offenen Kassadevisengeschäften in den Barmitteln in der Bilanz enthalten.

(n) Futures-Kontrakte

Die Ersteinschusszahlungen werden beim Abschluss von Futures-Kontrakten geleistet und erfolgen in der Regel in bar. Futures-Kontrakte werden zum beizulegenden Zeitwert auf der Grundlage ihrer täglich notierten Abwicklungspreise bewertet. Änderungen im Wert offener Futures-Kontrakte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Futures-Kontrakten erfasst, bis die Kontrakte beendet werden. Zu diesem Zeitpunkt werden realisierte Gewinne und Verluste als realisierte Gewinne oder Verluste erfasst und in der Gesamtergebnisrechnung als Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Die nicht realisierten Wertsteigerungen oder Wertminderungen von Futures-Kontrakten werden in der Bilanz ausgewiesen. Realisierte Gewinne und Verluste, die noch nicht erzielt wurden, werden in der Bilanz bei Einschusskosten und Barmitteln mit Verfügungsbeschränkung ausgewiesen.

(o) Optionskontrakte

Die Prämie auf gekaufte Put-Optionen wird bei der Ermittlung des realisierten Gewinns oder Verlusts vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung abgezogen. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Call-Optionen wird zu den Kosten der gekauften Wertpapiere oder Fremdwährung hinzuaddiert. Gezahlte Prämien aus dem Kauf von Optionen, die unausgeübt verfallen, werden als realisierte Verluste behandelt. Der nicht realisierte Gewinn oder Verlust aus offenen Optionspositionen wird als beizulegender Zeitwert der Option abzüglich der auf diese Option gezahlten Prämie berechnet und erfasst. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus offenen Optionspositionen werden in der Bilanz als Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Bei der Bestimmung des realisierten Gewinns oder Verlusts wird die Prämie auf verkaufte Call-Optionen zu den Erlösen aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung zur Bestimmung des realisierten Gewinns oder Verlustes hinzuaddiert. Die Prämie auf ausgeübte verkaufte Put-Optionen wird von den Kosten der gekauften Wertpapiere oder Fremdwährungen abgezogen. Prämien aus verkauften Optionen, die unausgeübt verfallen, werden als realisierte Gewinne behandelt.

(p) Swap-Instrumente

Swap-Instrumente werden zu ihrem beizulegenden Zeitwert am Tag des Abschlusses eines Derivatkontrakts erfasst und anschließend zu ihrem beizulegenden Zeitwert neu bewertet. Die beizulegenden Zeitwerte werden aus notierten Marktpreisen in aktiven Märkten, einschließlich aktueller Markttransaktionen, und mithilfe von Bewertungsmethoden, einschließlich diskontierter Cashflow-Modelle und Optionspreismodelle, ermittelt. Sämtliche Derivate werden als Vermögenswerte ausgewiesen, wenn der beizulegende Zeitwert positiv ist, und als Verbindlichkeiten, wenn der beizulegende Zeitwert negativ ist. Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts der Swap-Instrumente sowie gezahlte und erhaltene Zinsen aus den Swap-Instrumenten werden in der Gesamtergebnisrechnung beim Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden – (Fortsetzung)

(p) Swap-Instrumente – (Fortsetzung)

Credit Default Swaps

Jeder Rentenfonds (Rentenfonds gemäß der Definition auf Seite 15), mit Ausnahme des FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, kann Credit-Default-Swap-Vereinbarungen abschließen, sofern (i) die Credit-Default-Swap-Vereinbarung einer täglichen Bewertung durch die Fonds unterliegt und mindestens wöchentlich von unabhängiger Seite überprüft wird und (ii) die mit der Credit-Default-Swap-Vereinbarung verbundenen Risiken halbjährlich von unabhängiger Seite bewertet werden und der Bericht dem Verwaltungsrat zur Überprüfung vorgelegt wird. Ein Fonds kann bei einer Credit-Default-Swap-Transaktion entweder der Käufer oder der Verkäufer sein. Der „Käufer“ eines Credit-Default-Kontrakts ist verpflichtet, an die Gegenpartei während der Laufzeit des Kontrakts regelmäßige Zahlungen zu leisten, sofern kein Ausfallereignis bei einer zugrunde liegenden Referenzverbindlichkeit eingetreten ist. Ist ein Fonds der Käufer und tritt kein Ausfallereignis ein, verliert der Fonds seine Anlage und erhält nichts zurück. Ist der Fonds der Käufer und es tritt ein Ausfallereignis ein, erhält der Fonds (der Käufer) den vollen Nominalwert der Referenzverpflichtung, der gering oder gleich null sein kann. Ist der Fonds dagegen der Verkäufer und tritt ein Ausfallereignis ein, muss der Fonds (der Verkäufer) der Gegenpartei den vollen Nominalwert der Referenzverpflichtung im Gegenzug für die Referenzverpflichtung zahlen. Als Verkäufer erhält ein Fonds während der gesamten Laufzeit des Kontrakts, die in der Regel zwischen sechs Monaten und drei Jahren liegt, feste Erträge, sofern kein Ausfallereignis eintritt.

Die Fonds kaufen Credit Default Swaps, um sich gegen das Risiko eines Abfalls des Kapitalpreises oder des Ausfalls der von ihnen gehaltenen Schuldtitel abzusichern. Die Fonds verkaufen Credit Default Swaps, um am Anstieg des Kapitalpreises zu partizipieren. Das Ausfallrisiko wird vom Käufer von Credit-Default-Kontrakten auf den Fonds als Verkäufer des Credit Default Swaps übertragen. Dies beinhaltet das Risiko, dass der Swap wertlos verfällt, und das Kreditrisiko, dass der Verkäufer seinen Zahlungsverpflichtungen gegenüber den Fonds im Falle eines Verzugs nicht nachkommt. Die Fonds dürfen solche Transaktionen nur mit Gegenparteien mit einem Rating von A- oder höher abschließen.

Interest Rate Swaps

Bei einem Zinsswap oder Cross-Currency-Zinsswap tauscht ein Fonds mit einer anderen Partei seine jeweiligen Verpflichtungen zur Zahlung bzw. zum Erhalt von Zahlungsströmen, z. B. Zahlungen mit variablem Zinssatz gegen Zahlungen mit festem Zinssatz in der Basis- oder einer Fremdwährung. Der Kauf eines Caps berechtigt den Käufer, sofern ein bestimmter Index einen vorher festgelegten Wert überschreitet, zum Erhalt von Zahlungen auf einen fiktiven Kapitalbetrag von der Partei, die den Cap verkauft. Der Kauf eines Floors berechtigt den Käufer, sofern ein bestimmter Index unter einen vorher festgelegten Wert fällt, zum Erhalt von Zahlungen auf einen fiktiven Kapitalbetrag von der Partei, die den Floor verkauft. Ein Collar kombiniert Elemente des Kaufs eines Caps und des Verkaufs eines Floors. Spread Locks sind Kontrakte, die die Möglichkeit garantieren, einen Zinsswap zu einem im Voraus festgelegten Zinssatz über einem bestimmten Referenzsatz abzuschließen.

Aktien-Swaps

Aktien-Swaps sind Vereinbarungen zwischen einem Fonds und Dritten, die es den Fonds ermöglichen, ein Engagement in der Kursentwicklung bestimmter Wertpapiere zu erwerben, ohne die Wertpapiere tatsächlich zu kaufen. Die Änderungen der Kontraktwerte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste verbucht, und die Fonds weisen einen realisierten Gewinn oder Verlust aus, wenn der Kontrakt geschlossen wird.

Total Return Swaps

Bestimmte Fonds können in Total Return Swaps investieren, um ihr langfristiges Markt- und Kreditrisiko zu verringern. Total Return Swaps sind Kontrakte, bei denen ein Fonds eine Serie von Zahlungsströmen auf der Grundlage der Gesamtrendite eines bestimmten Vermögenswerts zahlt oder erhält und im Gegenzug einen festen oder variablen Zinssatz auf der Grundlage dieses bestimmten Vermögenswerts zahlt oder erhält. Total Return Swaps werden von einem unabhängigen Preisdienstleister zu Marktpreisen bewertet. Wenn der Preis nicht verfügbar ist, werden sie vom Franklin Templeton Global Valuation Committee (das „Valuation Committee“) angemessen bewertet. Diese Positionen werden monatlich mit dem Preis der Gegenpartei abgeglichen.

Cross-Currency-Swaps

Bei Cross-Currency-Swaps werden zwei verschiedene Währungen getauscht, wobei vereinbart wird, den Tausch zu einem späteren Zeitpunkt zu einem bestimmten Wechselkurs umzukehren. Der Tausch von Währungen zum Zeitpunkt des Vertragsabschlusses erfolgt zum aktuellen Kassakurs. Der Rücktausch bei Fälligkeit kann zum gleichen Kurs, zu einem bestimmten Kurs oder zum dann aktuellen Kassakurs erfolgen. Zinszahlungen werden gegebenenfalls zwischen den Parteien auf der Grundlage der zu Kontraktbeginn in den beiden Währungen verfügbaren Zinssätze geleistet.

Inflationsswaps

Bei Inflationsswaps wird ein fester Zinssatz auf einen fiktiven Kapitalbetrag gegen einen an den Inflationsindex gebundenen variablen Zinssatz getauscht. Die Partei, die den variablen Zinssatz zahlt, zahlt den inflationsbereinigten Zinssatz multipliziert mit dem fiktiven Kapitalbetrag.

Index-Swaps

Ein Index-Swap ist ein Absicherungskontrakt, bei dem eine Partei mit einer Gegenpartei einen im Voraus festgelegten Cashflow zu einem bestimmten Datum tauscht. Als vereinbarte Börse für eine Seite dieses Swaps wird ein Renten-, Aktien- oder anderer Preisindex herangezogen. Bei einem Overnight Index Swap wird ein Overnight Rate Index wie die Federal Funds Rate oder die London Interbank Offered Rate (LIBOR) herangezogen. Der Overnight Index Swap bezeichnet einen Zinsswap, bei dem der Tagesgeldsatz (Overnight Rate) gegen einen festen Zinssatz getauscht wird.

(q) Differenzkontrakte

Ein Differenzkontrakt ist eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien über den Tausch der Differenz zwischen dem Eröffnungskurs und dem Schlusskurs eines Kontrakts. Bei einem Long-Differenzkontrakt verpflichtet sich der Kontrahent, dem Fonds gegebenenfalls den Betrag zu zahlen, um den der Nominalwert des Kontrakts gestiegen wäre, wenn er in das zugrunde liegende Wertpapier oder die zugrunde liegenden Wertpapiere investiert worden wäre, zuzüglich etwaiger Dividenden, die auf diese Aktien gezahlt worden wären. Bei einem Short-Differenzkontrakt verpflichtet sich der Kontrahent, dem Fonds gegebenenfalls den Betrag zu zahlen, um den der Nominalwert des Kontrakts an Wert verloren hätte, wenn er in das zugrunde liegende Wertpapier oder die zugrunde liegenden Wertpapiere investiert worden wäre. Der Fonds muss der Gegenpartei auch den Wert etwaiger Dividenden zahlen, die er für diese Aktien erhalten hätte.

(r) Wertpapiere, die auf „To-be-announced“-Basis gehandelt werden

Die Fonds können Wertpapiere auf „To-be-announced“-Basis (TBA) handeln. Bei einem TBA-Geschäft verpflichtet sich ein Fonds zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren, für die zum Zeitpunkt des Geschäftsabschlusses noch keine spezifischen Informationen bekannt sind. Auf TBA-Basis gekaufte Wertpapiere werden erst abgerechnet, wenn sie an den betreffenden Fonds geliefert oder von ihm bezogen werden, normalerweise 15 bis 45 Tage später. Diese Geschäfte unterliegen laufenden Marktschwankungen und ihr Tageswert wird wie derjenige aller anderen Wertpapiere bestimmt.

(s) Kurzfristige Anlagen

Einlagenzertifikate, Termingelder und andere kurzfristige Anlagen bei Finanzinstituten werden zu ihrem Nennwert, gegebenenfalls mit aufgelaufenen Zinsen, bewertet.

(t) Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Ein Pensionsgeschäft ist eine Vereinbarung, nach der ein Fonds Wertpapiere oder mit einem Titel oder Wertpapier verbundene Rechte auf eine Gegenpartei überträgt, die sich verpflichtet, diese zu einem bestimmten Preis an einem festgelegten oder noch festzulegenden Datum zurückzukaufen. Ein umgekehrtes Pensionsgeschäft ist eine Vereinbarung, bei der ein Fonds Wertpapiere oder mit einem Titel oder Wertpapier verbundene Rechte von einer Gegenpartei erhält, die sich verpflichtet, diese zu einem bestimmten Preis an einem festgelegten oder noch festzulegenden Datum in der Zukunft zurückzukaufen.

Wertpapiere, die im Rahmen von Wiederverkaufsvereinbarungen erworben werden, werden zu ihrem Nennwert bewertet und um etwaige Wechselkursschwankungen bereinigt. Die Zinssätze variieren von Vereinbarung zu Vereinbarung und werden bei Vertragsbeginn festgelegt. Es gehört zu den Grundsätzen der Gesellschaft, die im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften erworbenen Wertpapiere zu verwahren und täglich zu bewerten, um die Gesellschaft für den Fall zu schützen, dass die Wertpapiere von der Gegenpartei nicht zurückgekauft werden. Die Gesellschaft erhält in der Regel zusätzliche Sicherheiten, wenn der Marktwert der zugrunde liegenden Wertpapiere unter dem Nennwert des umgekehrten Pensionsgeschäfts zuzüglich aufgelaufener Zinsen liegt. Bei Nichterfüllung der Rückkaufverpflichtung hat die Gesellschaft das Recht, die Sicherheiten zu verwerten und den Erlös zur Erfüllung der Verpflichtung zu verwenden. Im Falle der Nichterfüllung oder des Konkurses der Gegenpartei der Vereinbarung kann die Verwertung und/oder Einbehaltung der Sicherheiten oder Erlöse Gegenstand eines Gerichtsverfahrens sein. Umgekehrte Pensionsgeschäfte wurden während des Geschäftsjahres zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt.

(u) Börsengehandelte Fonds

Die Fonds können in börsengehandelte Fonds („ETFs“) investieren. Bei ETFs handelt es sich um Fonds, die einen Index oder einen Wertpapierkorb wie bei einem Indexfonds abbilden, jedoch wie eine Aktie an der Börse gehandelt werden. Diese Fonds unterliegen laufenden Marktschwankungen und ihr Tageswert wird wie derjenige aller anderen Wertpapiere bestimmt.

(v) Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen

Der beizulegende Zeitwert von Anlagen in offene Investmentfonds basiert auf dem ungeprüften Nettoinventarwert je Anteil, der von der jeweiligen Fondsverwaltung angegeben wird.

(w) Swaptions

Bestimmte Fonds können in Swaptions investieren, um sich gegen ungünstige Zinsschwankungen abzusichern. Diese Instrumente kombinieren die Merkmale von zwei anderen Finanzinstrumenten, nämlich einer Option und einem Zinsswap. Die Fonds verbuchen einen nicht realisierten Gewinn/Verlust (beizulegender Zeitwert) für den Betrag, der im Rahmen der Vereinbarung voraussichtlich eingehen oder gezahlt wird, wenn dieser Betrag bei der Bewertung gekündigt wurde. Der beizulegende Zeitwert wird täglich von Markt als Anbieter zur Verfügung gestellt. Der nicht realisierte Gewinn/Verlust wird in der Bilanz als finanzieller Vermögenswert oder finanzielle Verbindlichkeit ausgewiesen.

(x) Treasury Inflation-Protected Securities (TIPS)

Einige der Fonds können in indexgebundene Wertpapiere investieren. Indexgebundene Wertpapiere sind Wertpapiere, deren Preise an die Preise von Wertpapierindizes, Währungen oder andere Finanzstatistiken gekoppelt sind. Bei indexgebundenen Wertpapieren handelt es sich in der Regel um Schuldverschreibungen oder Einlagen, deren Wert bei Fälligkeit und/oder Kuponsatz durch Bezugnahme auf ein bestimmtes Instrument oder eine Statistik bestimmt wird. Die Wertentwicklung von indexgebundenen Wertpapieren schwankt (je nach Instrument entweder direkt oder invers) entsprechend der Wertentwicklung des Index, des Wertpapiers oder der Währung. Die Wertpapiere werden täglich vom jeweiligen Anbieter zum beizulegenden Zeitwert bewertet und die Änderung des beizulegenden Zeitwerts wird von den Fonds als nicht realisierter Gewinn oder Verlust verbucht.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden – (Fortsetzung)

(y) Schuldscheindarlehen und Darlehensbeteiligungen

Schuldscheindarlehen und Darlehensbeteiligungen sind fest- und variabel verzinsliche Darlehen, die durch private Verhandlungen zwischen einem Unternehmen oder einer anderen Art von Einrichtung und einem oder mehreren Finanzinstituten vereinbart werden. Solche Investitionen werden voraussichtlich in Form von Beteiligungen oder Abtretungen der Darlehen erfolgen, die verbrieft werden können oder nicht. Schuldscheindarlehen und Darlehensbeteiligungen werden von der Gesellschaft als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte eingestuft und zunächst zum beizulegenden Zeitwert erfasst. Gewinne und Verluste aus Änderungen des beizulegenden Zeitwerts der finanziellen Vermögenswerte werden in der Gesamtergebnisrechnung in dem Geschäftsjahr ausgewiesen, in dem sie entstehen.

(z) Master-Limited Partnership

Bestimmte Fonds können in Master-Limited Partnerships (MLPs) investieren, indem sie Anteile erwerben, die an Kommanditisten der MLP ausgegeben werden, die an geregelten Märkten öffentlich gehandelt werden. MLPs sind Kommanditgesellschaften oder Gesellschaften mit beschränkter Haftung, die in der Regel Einkünfte und Gewinne aus der Exploration, Erschließung, Lagerung, Gewinnung, dem Abbau, der Förderung, Verarbeitung, Raffination, dem Transport (einschließlich Pipelines für den Transport von Gas, Öl oder Produkten daraus) oder der Vermarktung von Mineralien oder natürlichen Ressourcen erzielen. MLPs haben in der Regel zwei Klassen von Eigentümern, den Komplementär und die Kommanditisten. Die Kommanditisten besitzen den übrigen Teil der Partnership (durch den Besitz von Stammanteilen) und spielen eine begrenzte Rolle im Geschäftsbetrieb und Management.

Der beizulegende Zeitwert einer Anlage in MLPs wird auf die gleiche Weise ermittelt wie bei anderen Wertpapieren. Die Veränderungen im beizulegenden Zeitwert werden als nicht realisierter Gewinn oder Verlust verbucht.

(aa) Zinserträge und -aufwendungen

Zinserträge und -aufwendungen umfassen Zinserträge und -aufwendungen für Barmittel, Barmitteläquivalente, Termineinlagen und Bareinschüsse. Zinserträge und -aufwendungen werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

(ab) Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung

„Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ in der Bilanz umfassen Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus noch nicht gelieferten Futures-Kontrakten. Einschusszahlungen werden in Bezug auf offene börsengehandelte und außerbörsliche Derivatekontrakte bei Brokern gehalten oder an Broker verpfändet. Barsicherheiten, die von den Fonds für den Handel mit Derivaten bereitgestellt oder entgegengenommen werden, werden in der Bilanz ebenfalls bei den Einschusskonten und den Barmitteln mit Verfügungsbeschränkung ausgewiesen und sind nicht als Bestandteile der Barmittel und Barmitteläquivalente enthalten. Bei den Barsicherheiten handelt es sich um Beträge im Zusammenhang mit dem Derivatehandel, die zum Jahresende bei Brokern gehalten werden. Die im Zusammenhang mit dem Derivatehandel erhaltenen Barsicherheiten werden bei The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, und etwaigen Unterverwahrestellen gehalten und sind am Jahresende an die Broker zu zahlen.

(ac) Forderungen aus Anlagen/für erworbene Anlagen gezahlten und fälligen rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen/wiedererworbenen rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

Forderungen aus Anlagen / verkauften rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen sind Forderungen aus Wertpapieren / verkauften rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen, die verkauft wurden, über die ein Vertrag abgeschlossen, die zum Datum der Darstellung der Vermögenslage jedoch noch nicht abgewickelt oder geliefert wurden. Diese Beträge werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert erfasst und anschließend zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

Die Verbindlichkeiten aus erworbenen / rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen, die wiedererworbenen wurden, sind Verbindlichkeiten aus gekauften Wertpapieren / wiedererworbenen rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen, über die ein Vertrag abgeschlossen, die zum Datum der Darstellung der Vermögenslage jedoch noch nicht abgewickelt oder geliefert wurden. Diese Beträge werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert erfasst und anschließend zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

(ad) Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile

Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile werden an einem Ex-Dividenden-Tag erfasst und in der Gesamtergebnisrechnung als „Finanzierungskosten“ ausgewiesen.

(ae) Leerverkaufte Wertpapiere

Bestimmte Fonds der Gesellschaft können sich an Leerverkäufen von Wertpapieren beteiligen. Die Gesellschaft tätigt Leerverkäufe, bei denen ein geliehenes Wertpapier in Erwartung eines Rückgangs des Marktwerts dieses Wertpapiers verkauft wird, oder sie kann Leerverkäufe für verschiedene Arbitragegeschäfte nutzen. Leerverkäufe werden zu Handelszwecken gehalten und folglich als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten eingestuft.

3. Effizientes Portfoliomanagement

Vorbehaltlich der Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die von Zeit zu Zeit von der Central Bank of Ireland (die „irische Zentralbank“) festgelegt werden, und sofern im Anlageziel und in der Anlagepolitik eines Fonds nicht anders angegeben, können die Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter Anlagetechniken und -instrumente wie Futures, Optionen, Devisenterminkontrakte und andere Derivate zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Darüber hinaus können neue Techniken und Instrumente entwickelt werden, die sich für den Einsatz durch einen Fonds in der Zukunft eignen, und ein Fonds kann solche Techniken und Instrumente vorbehaltlich der vorherigen Genehmigung durch die irische Zentralbank und etwaiger von ihr auferlegter Beschränkungen einsetzen.

Für OGAW, die Techniken und Instrumente zur effizienten Portfolioverwaltung angewendet haben, sind gemäß den UCITS Regulations der irischen Zentralbank bestimmte Offenlegungen erforderlich. OGAW sind verpflichtet, die Erträge aus Techniken und Instrumente für ein effizientes Portfoliomanagement für das gesamte Berichtsjahr zusammen mit den direkten und indirekten Betriebskosten und den angefallenen Gebühren auszuweisen. Nähere Angaben sind der nachstehenden Tabelle zu entnehmen.

Einzelheiten zu offenen Finanzderivaten am Ende des Geschäftsjahres werden im Anlagenportfolio der Fonds offengelegt. Alle realisierten Gewinne und Verluste, die aus der Verwendung derivativer Kontrakte für eine effiziente Portfolioverwaltung entstehen, sind in Nettogewinnen/-verlusten zu finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert durch Gewinn oder Verlust der Gesamtergebnisrechnung enthalten.

Während des Geschäftsjahres wurden umgekehrte Pensionsgeschäfte zum Zweck eines effizienten Portfoliomanagements abgeschlossen. Einzelheiten zu allen umgekehrten Pensionsgeschäften am Ende des Geschäftsjahres werden im Anlagenportfolio offengelegt.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Ein Teil des Vermögens eines jeden Fonds kann in zusätzlichen liquiden Mitteln gehalten werden. Zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements kann jeder Fonds Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen.

Die nachstehende Tabelle zeigt die Einnahmen aus umgekehrten Pensionsgeschäften in den Geschäftsjahren zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023:

Name des Fonds	29. Februar 2024 (in Tsd.)	28. Februar 2023 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	14.616 \$	5.725 \$

Bei den Käufen und Verkäufen von umgekehrten Pensionsgeschäften sind keine Transaktionskosten angefallen.

Wertpapierleihgeschäfte

Bestimmte Fonds können auch Wertpapierleihvereinbarungen zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, wie oben beschrieben, schließen. Bei solchen Transaktionen kann der Fonds seine Wertpapiere vorübergehend an einen Entleiher übertragen, wobei der Entleiher sich verpflichtet, dem Fonds zu einem vorher vereinbarten Zeitpunkt gleichwertige Wertpapiere zurückzugeben. Durch den Abschluss solcher Transaktionen versucht der Fonds, die Rendite seines Wertpapierportfolios zu erhöhen, indem er eine Gebühr für die Bereitstellung seiner Wertpapiere an den Entleiher erhält. In den Geschäftsjahren zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 wurden keine Wertpapierleihgeschäfte getätigt.

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und Franklin Templeton International Services S.à r.l (der „Manager“ oder „FTIS“) steht dem Manager eine Verwaltungsgebühr aus dem Vermögen des jeweiligen Fonds für seine Anlageverwaltungs- und Vertriebsleistungen zu, die an jedem Handelstag aufläuft und jeden Monat rückwirkend gezahlt wird (die „Verwaltungsgebühren“). Die Gesellschaft ist außerdem für die unverzügliche Zahlung oder Erstattung von Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnlichen Verbindlichkeiten, Kosten und Auslagen an den Manager verantwortlich, die von FTIS ordnungsgemäß zu zahlen sind oder entstehen.

Die maximale Verwaltungsgebühr für jede Anteilsklasse (als Prozentsatz des jeweiligen Nettoinventarwerts des Fonds, der auf diese Klasse entfällt), stellt sich zum Ende des Geschäftsjahres wie folgt dar:

Fondsname	Max. Verwaltungsgebühr	Fondsname	Max. Verwaltungsgebühr
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund	
Klasse A	0,800 %	Klasse A	0,800 %
Klasse B	1,050 %	Klasse B	1,050 %
Klasse C	1,300 %	Klasse C	1,300 %
Klasse E	1,400 %	Klasse E	1,400 %
Klasse X	0,600 %	Klasse F	0,550 % ¹
Klasse Premier	0,300 %	Klasse R	0,550 %
Klasse LM	keine	Klasse T	0,800 %
Klasse A (G)	0,800 %	Klasse X	0,300 %
Klasse L(G)	0,800 %	Klasse Premier	0,300 %
		Klasse S	0,200 %
		Klasse LM	keine
		Klasse GA	0,820 %
		Klasse GE	1,420 %

¹ Maximale Verwaltungsgebühr für Klasse F ausschüttend (D): 0,400 %.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr	Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Klasse A	1,000 %	Klasse A	0,850 %
Klasse B	1,250 %	Klasse B	1,100 %
Klasse C	1,500 %	Klasse C	1,350 %
Klasse E	1,600 %	Klasse E	1,450 %
Klasse F	0,550 %	Klasse F	0,600 %
Klasse R	0,600 %	Klasse R	0,450 %
Klasse T	1,000 %	Klasse T	0,850 %
Klasse X	0,300 %	Klasse X	0,350 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse Premier	0,350 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,250 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse LM	keine
Klasse B (G)	1,650 %	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]	
Klasse L(G)	1,650 %	Klasse A	0,900 %
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		Klasse B	1,150 %
Klasse A	0,800 %	Klasse C	1,400 %
Klasse B	1,050 %	Klasse E	1,500 %
Klasse C	1,300 %	Klasse F	0,650 %
Klasse E	1,400 %	Klasse R	0,500 %
Klasse F	0,550 %	Klasse T	0,900 %
Klasse R	0,400 %	Klasse X	0,400 %
Klasse T	0,800 %	Klasse Premier	0,400 %
Klasse X	0,300 %	Klasse S	0,300 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse LM	keine
Klasse S	0,200 %	FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]	
Klasse LM	keine	Klasse A	0,850 %
Klasse GA	0,820 %	Klasse B	1,100 %
Klasse GE	1,420 %	Klasse C	1,350 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		Klasse E	1,450 %
Klasse A	1,100 %	Klasse F	0,600 %
Klasse B	1,350 %	Klasse R	0,650 %
Klasse C	1,600 %	Klasse T	0,850 %
Klasse E	1,700 %	Klasse X	0,350 %
Klasse F	0,650 %	Klasse Premier	0,350 %
Klasse R	0,700 %	Klasse S	0,250 %
Klasse T	1,100 %	Klasse LM	keine
Klasse X	0,550 %	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]	
Klasse Premier	0,400 %	Klasse A	1,500 %
Klasse LM	keine	Klasse B	1,750 %
FTGF Western Asset US High Yield Fund		Klasse C	2,000 %
Klasse A	0,950 %	Klasse E	2,100 %
Klasse B	1,200 %	Klasse F	1,250 %
Klasse C	1,450 %	Klasse R	1,100 %
Klasse E	1,550 %	Klasse T	1,500 %
Klasse F	0,700 %	Klasse X	1,000 %
Klasse R	0,550 %	Klasse Y	1,000 %
Klasse T	0,950 %	Klasse Premier	1,000 %
Klasse X	0,450 %	Klasse S	0,600 %
Klasse Premier	0,450 %	Klasse LM	keine
Klasse S	0,300 %	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]	
Klasse LM	keine	Klasse A	1,250 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse B	1,500 %
Klasse L(G)	1,650 %	Klasse C	1,750 %
Klasse GF	0,950 %	Klasse E	1,850 %
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Klasse F	0,800 %
Klasse A	0,950 %	Klasse R	0,750 %
Klasse B	1,250 %	Klasse T	1,250 %
Klasse C	1,450 %	Klasse X	0,625 %
Klasse E	1,550 %	Klasse Premier	0,600 %
Klasse F	0,700 %	Klasse S	0,400 %
Klasse R	0,850 %	Klasse LM	keine
Klasse T	0,950 %	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]	
Klasse X	0,450 %	Klasse D	1,200 %
Klasse Premier	0,450 %	Klasse F	1,200 %
Klasse S	0,300 %	Klasse M	0,600 %
Klasse LM	keine	Klasse Premier	0,600 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse LM	keine
Klasse L(G)	1,750 %	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]	
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		Klasse A	1,000 %
Klasse A	1,100 %	Klasse B	1,250 %
Klasse B	1,350 %	Klasse C	1,500 %
Klasse C	1,600 %	Klasse E	1,600 %
Klasse E	1,700 %	Klasse F	0,550 %
Klasse F	0,850 %	Klasse R	0,600 %
Klasse R	0,700 %	Klasse X	0,500 %
Klasse T	1,100 %	Klasse Premier	0,300 %
Klasse X	0,600 %	Klasse LM	keine
Klasse Premier	0,600 %	FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]	
Klasse LM	keine	Klasse A	0,800 %
		Klasse R	0,500 %
		Klasse T	0,800 %
		Klasse X	0,400 %
		Klasse Premier	0,300 %
		Klasse S	0,200 %
		Klasse LM	keine

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr	Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]	
Klasse A	0,800 %	Klasse A	1,650 %
Klasse F	0,550 %	Klasse B	1,900 %
Klasse R	0,500 %	Klasse C	2,150 %
Klasse T	0,800 %	Klasse E	2,250 %
Klasse X	0,300 %	Klasse F	1,300 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse J	0,750 %
Klasse S	0,200 %	Klasse R	1,250 %
Klasse LM	keine	Klasse T	1,650 %
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]		Klasse X	1,150 %
Klasse LM	keine	Klasse Premier	1,150 %
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		Klasse S	0,750 %
Klasse A	0,850 %	Klasse LM	keine
Klasse B	1,100 %	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]	
Klasse C	1,350 %	Klasse A	1,050 %
Klasse E	1,450 %	Klasse B	1,300 %
Klasse F	0,600 %	Klasse C	1,550 %
Klasse R	0,650 %	Klasse E	1,650 %
Klasse T	0,850 %	Klasse F	0,700 %
Klasse X	0,350 %	Klasse T	1,050 %
Klasse Premier	0,350 %	Klasse X	0,525 %
Klasse S	0,250 %	Klasse Premier	0,525 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,400 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		Klasse LM	keine
Klasse A	1,100 %	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]	
Klasse B	1,350 %	Klasse A	2,000 %
Klasse C	1,600 %	Klasse T	2,000 %
Klasse E	1,700 %	Klasse U	1,000 %
Klasse F	0,850 %	Klasse X	1,150 %
Klasse R	0,700 %	Klasse Premier	1,150 %
Klasse T	1,100 %	Klasse LM	keine
Klasse X	0,600 %	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]	
Klasse Premier	0,600 %	Klasse A	1,100 %
Klasse LM	keine	Klasse B	1,350 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		Klasse C	1,600 %
Klasse A	1,350 %	Klasse E	1,700 %
Klasse B	1,600 %	Klasse F	0,800 %
Klasse C	1,850 %	Klasse J	0,450 %
Klasse E	1,950 %	Klasse R	0,700 %
Klasse F	1,100 %	Klasse T	1,100 %
Klasse J	0,900 %	Klasse X	0,550 %
Klasse R	0,950 %	Klasse Premier	0,550 %
Klasse X	0,900 %	Klasse S	0,450 %
Klasse Premier	0,900 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]	
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		Klasse A	0,800 %
Klasse A	1,100 %	Klasse B	1,050 %
Klasse F	0,750 %	Klasse C	1,300 %
Klasse T	1,100 %	Klasse E	1,400 %
Klasse X	0,550 %	Klasse F	0,550 %
Klasse Premier	0,550 %	Klasse R	0,600 %
Klasse S	0,450 %	Klasse T	0,800 %
Klasse LM	keine	Klasse X	0,300 %
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Klasse Premier	0,300 %
Klasse A	1,150 %	Klasse S	0,200 %
Klasse B	1,400 %	Klasse LM	keine
Klasse C	1,650 %	FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]	
Klasse E	1,750 %	Klasse A	1,200 %
Klasse F	0,900 %	Klasse E	1,950 %
Klasse R	0,750 %	Klasse F	0,950 %
Klasse T	1,150 %	Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,650 %	Klasse T	1,200 %
Klasse Premier	0,650 %	Klasse X	0,600 %
Klasse LM	keine	Klasse Premier	0,600 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		Klasse S	0,500 %
Klasse A	1,100 %	Klasse LM	keine
Klasse B	1,350 %	FTGF ClearBridge Value Fund	
Klasse C	1,600 %	Klasse A	1,350 %
Klasse E	1,700 %	Klasse B	1,850 %
Klasse F	0,800 %	Klasse C	1,850 %
Klasse J	0,450 %	Klasse E	2,100 %
Klasse R	0,700 %	Klasse F	1,100 %
Klasse T	1,100 %	Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,450 %	Klasse T	1,350 %
Klasse Premier	0,450 %	Klasse X	0,675 %
Klasse S	0,350 %	Klasse Premier	0,675 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr	Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]	
Klasse A	1,250 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,750 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	1,750 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,000 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,000 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	0,750 %	Klasse R	1,000 %
Klasse T	1,250 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,625 %	Klasse U	0,650 %
Klasse Premier	0,625 %	Klasse X	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse Premier	0,750 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse LM	keine
Klasse B (G)	1,750 %	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	
Klasse L(G)	1,750 %	Klasse A	1,500 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse B	2,000 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse C	2,000 %
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Klasse E	2,250 %
Klasse A	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse B	1,750 %	Klasse R	1,000 %
Klasse C	1,750 %	Klasse T	1,500 %
Klasse E	2,000 %	Klasse U	0,600 %
Klasse F	1,000 %	Klasse X	0,750 %
Klasse R	0,750 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse T	1,250 %	Klasse S	0,400 %
Klasse U	0,525 %	Klasse LM	keine
Klasse X	0,625 %	FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^]	
Klasse Premier	0,625 %	Klasse A	1,300 %
Klasse LM	keine	Klasse B	1,800 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse C	1,800 %
Klasse L(G)	1,750 %	Klasse E	2,050 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse F	1,050 %
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		Klasse R	0,800 %
Klasse A	1,300 %	Klasse T	1,300 %
Klasse B	1,800 %	Klasse X	0,650 %
Klasse C	1,800 %	Klasse Premier	0,650 %
Klasse E	2,050 %	Klasse S	0,300 %
Klasse F	1,050 %	Klasse LM	keine
Klasse R	0,800 %	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Klasse T	1,300 %	Klasse A	1,500 %
Klasse X	0,650 %	Klasse B	2,000 %
Klasse Premier	0,650 %	Klasse C	2,000 %
Klasse LM	keine	Klasse E	2,250 %
Klasse A (G)	1,300 %	Klasse F	1,250 %
Klasse B (G)	1,800 %	Klasse R	1,000 %
Klasse L(G)	1,800 %	Klasse T	1,500 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse X	0,750 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse Premier	0,750 %
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Klasse LM	keine
Klasse A	1,250 %	FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
Klasse B	1,750 %	Klasse A	1,500 %
Klasse C	1,750 %	Klasse B	2,000 %
Klasse E	2,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse F	1,000 %	Klasse E	2,250 %
Klasse R	0,800 %	Klasse F	1,250 %
Klasse T	1,250 %	Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,625 %	Klasse T	1,500 %
Klasse Premier	0,625 %	Klasse X	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse Premier	0,750 %
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]		Klasse LM	keine
Klasse A	1,200 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse B	1,700 %	Klasse L(G)	1,750 %
Klasse C	1,700 %	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]	
Klasse E	1,950 %	Klasse A	1,500 %
Klasse F	0,950 %	Klasse B	2,000 %
Klasse R	0,700 %	Klasse C	2,000 %
Klasse T	1,200 %	Klasse E	2,250 %
Klasse X	0,600 %	Klasse F	1,250 %
Klasse Premier	0,600 %	Klasse R	1,000 %
Klasse S	0,400 %	Klasse T	1,500 %
Klasse LM	keine	Klasse X	0,750 %
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]		Klasse Premier	0,750 %
Klasse A	1,300 %	Klasse S	0,550 %
Klasse B	1,800 %	Klasse LM	keine
Klasse C	1,800 %	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^]	
Klasse E	2,050 %	Klasse A	1,350 %
Klasse F	1,050 %	Klasse B	1,850 %
Klasse R	0,800 %	Klasse C	1,850 %
Klasse T	1,300 %	Klasse E	2,100 %
Klasse X	0,650 %	Klasse F	1,100 %
Klasse Premier	0,650 %	Klasse R	0,850 %
Klasse S	0,550 %	Klasse T	1,350 %
Klasse LM	keine	Klasse X	0,675 %
		Klasse Premier	0,675 %
		Klasse S	0,500 %
		Klasse LM	keine
		Klasse GA	1,620 %
		Klasse GE	2,370 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fondsname	Max. Verwaltungsgebüh- r	Fondsname	Max. Verwaltungsgebüh- r
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse M	1,000 %	Klasse J	0,650 %
Klasse R	1,000 %	Klasse R	1,000 %
Klasse T	1,500 %	Klasse T	1,500 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse X	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse Premier	0,750 %
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]		FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %	Klasse R	1,000 %
Klasse T	1,500 %	Klasse X	0,750 %
Klasse X	0,750 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse S	0,650 %
Klasse S	0,650 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]	
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		Klasse A	1,500 %
Klasse A	1,500 %	Klasse B	2,000 %
Klasse B	2,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse C	2,000 %	Klasse E	2,250 %
Klasse D	1,100 %	Klasse F	1,250 %
Klasse E	2,250 %	Klasse R	1,000 %
Klasse F	1,250 %	Klasse T	1,500 %
Klasse R	1,000 %	Klasse X	0,750 %
Klasse T	1,500 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse X	0,750 %	Klasse S	0,440 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse LM	keine
Klasse S	0,440 %	Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]	
Klasse LM	keine	Klasse A	0,60 %
		Klasse D	1,15 %
		Klasse K	0,60 %
		Klasse X	0,20 %

Die in den obenstehenden Tabellen angegebenen Verwaltungsgebühren für die einzelnen Fonds gelten für alle in der jeweiligen Spalte aufgeführten Anteilsklassen, die der Fonds anbietet. Es werden nicht alle Anteilsklassen von jedem Fonds angeboten und am Ende des laufenden und des davorliegenden Geschäftsjahres waren nicht alle Anteilsklassen in Umlauf. Welche Anteilsklassen die einzelnen Fonds anbieten, ist im Verkaufsprospekt angegeben, der von Zeit zu Zeit geändert oder ersetzt werden kann.

Gemäß jedem Anlageverwaltungsvertrag ist der Verwalter für die Zahlung der Gebühren und Auslagen des betreffenden Anlageverwalters verantwortlich.

Der Verwalter hat sich freiwillig bereit erklärt, teilweise auf seine Gebühren zu verzichten und/oder bestimmte Kosten zu erstatten, sodass die Gesamtkosten gewisse freiwillige Kostengrenzen, die für die Fonds festgelegt wurden, nicht überschreiten. Dem Verwalter steht es frei, den freiwilligen Verzicht und/oder die Kostenerstattungen in eigenem Ermessen jederzeit zu überprüfen oder zu beenden.

Für die am 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahre hat der Verwalter folgende Gebühren erlassen bzw. erstattet:

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)		Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	
	Erlassene Verwaltungsgebüh- r	Erstattete Verwaltungsgebühren und sonstige Ausgaben	Erlassene Verwaltungsgebüh- r	Erstattete Verwaltungsgebühren und sonstige Ausgaben
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	– \$	– \$	622 \$	23 \$
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	– \$	56 \$	9 \$	– \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	– \$	– \$	3 \$	– \$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	– \$	– \$	3 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	2 \$	1 \$	– \$	1 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	1 \$	1 \$	2 \$	2 \$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	– \$	– \$	– \$	10 \$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	– \$	– \$	– \$	17 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	8 \$	– \$	– \$	– \$
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	– \$	– \$	14 \$	13 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	2 \$	– \$	– \$	– \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	10 \$	– \$	– \$	– \$
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	– €	– €	– €	11 €
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	– \$	– \$	1 \$	– \$
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	– \$	9 \$	– \$	– \$
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	– \$	66 \$	– \$	76 \$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	20 \$	33 \$	28 \$	22 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	49 \$	8 \$	35 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	57 \$	11 \$	22 \$	3 \$
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	– \$	– \$	32 \$	33 \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	– \$	27 \$	– \$	24 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	54 \$	16 \$	17 \$	15 \$
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	19 \$	1 \$	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	– \$	– \$	10 \$	47 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	46 \$	– \$	19 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	41 \$	– \$	25 \$	– \$
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	– \$	– \$	14 \$	24 \$
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	7 \$	23 \$	– \$	– \$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)		Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	
	Erlassene Verwaltungsgebühr	Erstattete Verwaltungsgebühren und sonstige Ausgaben	Erlassene Verwaltungsgebühr	Erstattete Verwaltungsgebühren und sonstige Ausgaben
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	31 \$	41 \$	26 \$	2 \$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	- €	- €	1 \$	7 €
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	1 \$	38 \$	1 \$	- \$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	- \$	- \$	- \$	33 \$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	1 \$	15 \$	35 \$	- \$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	19 \$	- \$	- \$	- \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	11 \$	13 \$	2 \$	7 \$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	52 \$	- \$	36 \$	- \$
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	2 \$	- €	6 €	5 €
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	4 \$	71 \$	- \$	- \$
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	10 \$	- €	6 €	14 €

Als „-“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR.

Gemäß jedem Anlageverwaltungsvertrag hat jeder Anlageverwalter Anspruch auf eine Anlageverwaltungsgebühr, und jeder Anlageverwalter ist dafür verantwortlich, die Gebühren und Auslagen der Unteranlageverwalter aus seiner eigenen Anlageverwaltungsgebühr (die auch „Performancegebühren“ enthalten kann) zu zahlen.

Gemäß den Bedingungen des Hauptvertriebsvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors, LLC (die „Hauptvertriebsstelle“) ist die Hauptvertriebsstelle befugt, Anteile der Gesellschaft zu vermarkten, zu bewerben, anzubieten und den Verkauf und die Rücknahme von Anteilen der Gesellschaft zu organisieren (zusammenfassend als „Vertriebsdienstleistungen“ bezeichnet). Darüber hinaus ist die Hauptvertriebsstelle berechtigt, auf eigene Kosten eine oder mehrere Vertriebsstellen zu beauftragen, die sie bei der Erfüllung ihrer Aufgaben und Verantwortlichkeiten unterstützen, vorausgesetzt, die Ernennung dieser anderen Firmen erfolgt nach den Vorschriften der Zentralbank. Gemäß den Bestimmungen des Hauptvertriebsvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und der Hauptvertriebsstelle bleibt die Hauptvertriebsstelle in solchen Fällen gegenüber dem Manager für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag verantwortlich. Die Hauptvertriebsstelle hat gemäß den Vorschriften der Zentralbank Franklin Templeton Investments (Asia) Limited („FTIA“) und Templeton Asset Management Ltd. („TAM“) als zusätzliche Vertriebsstellen für die Fonds ernannt. Der Manager hat außerdem sich selbst und Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. mit der Erbringung bestimmter Vertriebsdienstleistungen beauftragt.

Die Gesellschaft ist außerdem für die unverzügliche Zahlung oder Erstattung von Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnlichen Verbindlichkeiten, Kosten und Auslagen an den Manager verantwortlich, die vom Manager ordnungsgemäß zu zahlen sind oder ihm entstehen.

Informationsstellengebühr

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und dem Verwalter steht dem Verwalter eine Informationsstellengebühr aus dem Vermögen der jeweiligen Fonds für seine Dienstleistungen zu, die an jedem Handelstag auflaufen und monatlich rückwirkend zahlbar sind (die „Informationsstellengebühren“). Die Informationsstellengebühren sind monatlich rückwirkend zu zahlen und laufen an jedem Handelstag auf. Gemäß dem Haupt-Informationenstellenvertrag zwischen dem Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors, LLC (die „Hauptinformationsstelle“) ist die Hauptinformationsstelle berechtigt, vom Manager für ihre Dienste als Informationsstelle eine Gebühr für bestimmte Aktienklassen zu verlangen.

Gemäß den Bedingungen des Haupt-Informationenstellenvertrags ist die Hauptinformationsstelle berechtigt, auf eigene Kosten und Ausgaben eine oder mehrere Parteien zu beauftragen, die sie bei der Erfüllung ihrer Aufgaben im Rahmen des Vertrags unterstützen, wobei die Hauptinformationsstelle gegenüber dem Manager für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen im Rahmen dieses Vertrags verantwortlich bleibt. Infolgedessen hat die Hauptinformationsstelle FTIA und TAM als zusätzliche Informationsstellen der Gesellschaft bestellt. Der Manager hat Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc ermächtigt, Informationsstellendienste in Bezug auf Taiwan zu erbringen.

Der Gesamtbetrag der von jeder Anteilsklasse gezahlten Informationsstellengebühren entspricht bzw. entsprach den folgenden Beträgen:

- 0,15 % p.a. des Nettoinventarwerts beim FTGF Western Asset US Core Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset Global High Yield Fund, FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund, FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Credit Fund[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] und FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]
- 0,35 % des Nettoinventarwerts beim FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^], FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^].

Die Informationsstellengebühren sind für alle Anteilsklassen mit Ausnahme der Anteilsklassen F, Anteilsklassen J, Anteilsklassen U, Anteilsklassen Y, Anteilsklassen Premier, Anteilsklassen S, Anteilsklassen LM, Grandfathered-Anteilsklassen und Galleon-Anteilsklassen (jeweils wie im Prospekt definiert) zu entrichten und sind auch nicht für sämtliche Anteilsklassen zahlbar, die von FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] angeboten werden.

In den Geschäftsjahren zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 wurde auf folgende Informationsstellengebühren verzichtet:

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
	Verzichtet Informationsstellengebühr	Verzichtet Informationsstellengebühr
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	8 \$	42 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	3 \$	12 \$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	- \$	21 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	1 \$	- \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	5 \$	6 \$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	- \$	4 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	35 \$	21 \$
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	- \$	5 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	2 \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	4 \$	8 \$
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	- \$	1 \$
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	7 \$	15 \$
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	2 \$	- \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	33 \$	21 \$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	96 \$	89 \$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	2 \$	1 \$
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	- \$	2 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	2 \$	- \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	16 \$	11 \$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	- €	1 \$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
	Verzicht Informationsstellengebühr	Verzicht Informationsstellengebühr
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	2 \$	30 \$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	1 \$	8 \$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	8 \$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	41 \$	31 \$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	7 \$	5 \$
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	1 \$	– \$

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR.

Zusätzlich bestimmte Betriebsaufwendungen, einschließlich unter anderem an die Tochtergesellschaften von Franklin Templeton für die Erbringung von Governance-Support und die Berichterstattung an den Verwaltungsrat, für Versicherungsleistungen für den Verwaltungsrat und fortlaufende Registrierungsleistungen in Ländern und Regionen, in denen die Fonds öffentlich angeboten werden. Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 beliefen sich diese Aufwendungen auf 1.037.845 \$ (28. Februar 2023: 1.313.151 \$).

Verbundene Parteien

Jane Trust (bis zu ihrem Rücktritt), Jaspal Sagger, William Jackson (bis zu seinem Rücktritt), Craig Tyle und Elinor Murray waren Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft und auch Verwaltungsratsmitglieder und/oder Führungskräfte bestimmter verbundener Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter, der Vertriebs- und Informationsstellen. William Jackson und Jane Trust waren (bis zu ihrem jeweiligen Rücktritt) Verwaltungsratsmitglieder von FTIS. Abgesehen von den oben genannten Ausnahmen hat bzw. hatte keiner der Verwaltungsratsmitglieder eine direkte oder indirekte Beteiligung an einem Vertrag oder einer Vereinbarung, der/die zum Zeitpunkt dieses Dokuments besteht und der/die in Bezug auf das Geschäft der Gesellschaft von Bedeutung ist.

Zum 29. Februar 2024 und zum 28. Februar 2023 hielten die in der nachfolgenden Tabelle aufgelisteten Fonds Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen, die denselben Manager, dieselben Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter wie der Fonds haben oder die eine verbundene Partei dieses Managers, dieser Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter bestellt haben.

Nachstehende Tabelle zeigt den von der Gesellschaft gehaltenen Anteil an diesen Organismen für gemeinsame Anlagen:

Fonds	Zugrunde liegender Organismus für gemeinsame Anlagen	29. Februar 2024		28. Februar 2023	
		%	Wert (in Tsd.)	%	Wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,12 %	3.108 \$	0,07 %	1.741 \$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	782 €	0,03 %	654 €
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM EUR thesaurierend	–	–	12,62 %	1.117 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	10,61 %	3.139 \$	21,75 %	2.899 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	577 \$	0,07 %	1.661 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM EUR thesaurierend	–	–	1,50 %	133 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,22 %	5.476 \$	0,17 %	3.862 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,04 %	1.097 \$	0,73 %	17.040 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	2,92 %	10.594 \$	3,14 %	10.921 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	4,37 %	1.292 \$	2,22 %	296 \$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	69 \$	0,02 %	559 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM EUR thesaurierend	–	–	24,65 %	2.181 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,57 %	39.783 \$	0,70 %	16.369 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM EUR thesaurierend	–	–	5,73 %	507 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,85 %	21.501 \$	0,74 %	17.212 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,69 %	17.502 \$	0,05 %	1.154 \$
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	133 \$	0,06 %	1.342 \$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	–	–	0,00 %	30 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,10 %	2.596 \$	–	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,32 %	8.090 \$	–	–
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	718 \$	–	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,14 %	3.580 \$	–	–
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,81 %	20.461 \$	–	–
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,05 %	1.264 \$	–	–
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	579 \$	–	–
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,04 %	1.040 \$	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,69 %	17.542 \$	1,39 %	32.545 \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	1.681 \$	0,05 %	1.100 \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	209 \$	0,01 %	180 \$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,06 %	1.620 \$	–	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fonds	Zugrunde liegender Organismus für gemeinsame Anlagen	29. Februar 2024		28. Februar 2023	
		%	Wert (in Tsd.)	%	Wert (in Tsd.)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	142 \$	–	–
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	420 \$	–	–

Überkreuzbeteiligungen von Fonds sind in Erläuterung 13 zum Abschluss enthalten.

Transaktionskosten

Die Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe von Aktien, Organismen für gemeinsame Anlagen, Futures-Kontrakte und Optionen für die Geschäftsjahre zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

Name des Fonds	29. Februar 2024 (in Tsd.)	28. Februar 2023 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	31 \$	32 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	192 \$	248 \$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	8 €	10 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	\$ 5	9 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	\$ 1	6 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	– \$	1 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	8 \$	5 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	18 \$	14 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	12 \$	14 \$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	3 \$	3 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	6.442 \$	9.768 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	25 \$	32 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	8 \$	23 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	38 \$	51 \$
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	– £	1 \$
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	– \$	7 \$
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	10 \$	11 \$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	15 \$	2 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	8 \$	90 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	1 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	15 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	74 \$	41 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	2 \$	16 \$
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	8 \$	4 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	1 \$	– \$
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	2 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	– \$	\$ 1
FTGF ClearBridge Value Fund	350 \$	260 \$
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	6 \$	4 \$
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	31 \$	57 \$
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	11 \$	36 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	5 \$	3 \$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	111 \$	81 \$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	9 \$	7 \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	777 €	1.247 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	453 \$	904 \$
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	11 \$	– \$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	1.161 \$	1.128 \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	94 \$	91 \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	4 \$	5 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	– \$	11 \$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	– \$	32 \$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	99 \$	181 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	18 \$	13 €
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	22 \$	40 \$
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	81 €	153 €
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	8 \$	– \$

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 GBP.

Performancegebühr

Zusätzlich zu den oben beschriebenen Anlageverwaltungsgebühren kann der Anlageverwalter Anspruch auf eine Gebühr (eine „Performancegebühr“) haben, die von der Wertentwicklung der Anteile der Klasse PF (Klassen mit Performancegebühr, wie durch „(PF)“ im Namen der Anteilsklasse angegeben) abhängt.

In den Geschäftsjahren zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 wurden keine Performancegebühren erhoben, da keine aktiven (PF)-Anteilsklassen in Umlauf waren.

Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren

The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, fungiert als Verwahrstelle (die „Verwahrstelle“), und BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company als Verwaltungsstelle (die „Verwaltungsstelle“) für alle Fonds der Gesellschaft. Für Verwaltungs-, Buchhaltungs-, Informationsstellen-, Treuhänder- und Verwahrstellendienste erhalten sie von den Fonds zusammen eine Gebühr von bis zu 0,15 % des Nettoinventarwerts jedes Fonds.

Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrats

Die sich auf das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 beziehenden ergebniswirksam in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Honorare und Auslagen der Mitglieder des Verwaltungsrats beliefen sich auf 198.000 USD (28. Februar 2023: 143.000 USD).

Verwaltungsrats honorare sind oder waren nicht zahlbar für Jane Trust, Jaspal Sagger, William Jackson (bis zu seinem Rücktritt), Craig Tyle und Elinor Murray, die Mitarbeiter des Managers, der Anlageverwalter oder ihrer verbundenen Unternehmen sind.

Prüfungshonorar

Die an den Abschlussprüfer, PricewaterhouseCoopers, für das Geschäftsjahr gezahlten Honorare in Höhe von 1.017.115 EUR (ohne MwSt.) beziehen sich auf die gesetzliche Prüfung des Jahresabschlusses der Gesellschaft (28. Februar 2023): 1.064.363 EUR (ohne MwSt.). Das gesamte Prüfungshonorar für die Gesellschaft, wie in der Gesamtergebnisrechnung auf Seite 190 aufgeführt, enthält die Mehrwertsteuer in Höhe von 23 % und ist in der Berichtswährung der Gesellschaft (US-Dollar) angegeben.

Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 beliefen sich die an den Abschlussprüfer gezahlten Auslagen auf 12.100 EUR (28. Februar 2023: 11.804 EUR).

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

Die nachstehende Tabelle enthält die prozentualen Beteiligungen der wesentlichen Anteilinhaber, die mehr als 20 % des umlaufenden Anteilskapitals des Fonds halten:

Fonds	Beteiligung in % 29. Februar 2024	Beteiligung in % 28. Februar 2023
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	75,72	71,16
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	–	21,10
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	21,36	–
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	82,67	92,89
FTGF Western Asset US High Yield Fund	30,69	34,32
FTGF Western Asset US High Yield Fund	20,49	–
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	34,37	29,86
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	23,37	21,21
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	23,69	–
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	26,95	29,89
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	25,55	26,15
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	22,55	–
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	66,32	68,41
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	70,85	77,47
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	25,18	–
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	31,37	35,78
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	83,11	68,68
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	94,53	94,78
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	–	100,00
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^	–	81,03
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund^	97,99	95,79
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	–	65,31
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	–	23,18
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	56,37	32,53
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	–	23,04
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	39,29	96,36
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	28,61	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	52,74	51,35
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	–	21,00
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	29,66	31,26
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	28,30	27,49
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	45,98	40,60
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	22,36	26,66
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	–	99,01
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	91,03	91,03
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	100,00	100,00
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	100,00	–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	–	75,02
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	31,30	32,03
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	36,64	–
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	26,41	–
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	27,17	45,87
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	39,28	34,53
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	54,35	54,38
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	28,64	21,50
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	28,16	27,65
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	22,33	21,57
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	100,00	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	44,03	40,84
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	99,91	99,79
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^	–	41,38
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	–	22,30
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	–	21,52
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	57,00	60,68
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	20,19	–
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	54,30	58,97
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	25,32	23,93
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	31,20	27,69
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	25,70	26,36
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	25,22	26,85
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	24,33	20,92
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	20,19	–
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	83,18	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund^	36,32	53,20
Franklin Responsible Income 2028 Fund^	–	24,34

Beträge, die mit „–“ angegeben sind, belaufen sich auf 0.

5. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

Ausschüttende Anteilsklassen

Der Buchstabe in Klammern am Ende des Namens jeder ausschüttenden Anteilsklasse weist auf eine bestimmte Häufigkeit der Dividendenerklärungen und -zahlungen hin, wie in der folgenden Tabelle angegeben.

Bezeichnung der ausschüttenden Anteilsklasse	Häufigkeit der Dividendenbekanntgabe	Häufigkeit der Dividendenzahlungen
(D)	Täglich	Monatlich
(M)	Monatlich	Monatlich
(Q)	Vierteljährlich	Vierteljährlich (März, Juni, September, Dezember)
(S)	Halbjährlich	Halbjährlich (März, September)
(A)	Jährlich	Jährlich (März)

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Rentenfonds (Rentenfonds wie auf Seite 15 definiert) zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung gilt: (1) Etwaige Nettoanlageerträge werden ganz oder teilweise als Dividende erklärt; und (2) realisierte und nicht realisierte Kapitalgewinne können (müssen aber nicht) abzüglich der realisierten und nicht realisierten Kapitalverluste ganz oder teilweise als Dividende festgesetzt werden.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Aktienfonds (Aktienfonds wie auf Seite 15 definiert) werden zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung etwaige Nettoanlageerträge ganz oder teilweise als Dividende erklärt. Für jeden Anteilinhaber jeder ausschüttenden Anteilsklasse werden die Ausschüttungen in der Währung vorgenommen, in der der Anteilinhaber die Anteile gezeichnet hat, es sei denn, der Anteilinhaber verlangt etwas anderes.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

5. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen – (Fortsetzung)

Für jede ausschüttende Anteilklasse jedes Multi-Asset-Fonds (Multi-Asset-Fonds wie auf Seite 15 definiert) werden zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung etwaige Nettoanlageerträge ganz oder teilweise als Dividende erklärt. Für jeden Anteilinhaber jeder ausschüttenden Anteilklasse werden die Ausschüttungen in der Währung vorgenommen, in der der Anteilinhaber die Anteile gezeichnet hat, es sei denn, der Anteilinhaber verlangt etwas anderes.

Die ausschüttenden Plus-Anteilsklassen können Ausschüttungen aus dem Kapital beschließen und zahlen. Die Anleger dieser Anteilsklassen sollten sich darüber im Klaren sein, dass die Zahlung von Dividenden aus dem Kapital einer Rückgabe oder Entnahme eines Teils der ursprünglichen Anlage des Anlegers oder der dieser ursprünglichen Anlage zurechenbaren Kapitalgewinne gleichkommt, und dass solche Ausschüttungen zu einem entsprechenden unmittelbaren Rückgang des Nettoinventarwerts je Anteil der Anteilklasse führen werden. Die Zahlung von Ausschüttungen aus dem Kapital führt demnach zu einer Kapitalerosion und kann durch den Verzicht auf das Potenzial für künftiges Kapitalwachstum erreicht werden.

Während des Geschäftsjahres haben die folgenden Fonds Ausschüttungen aus dem Kapital der ausschüttenden Plus-Anteilsklassen vorgenommen:

	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	47 \$	51 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	9 \$	67 \$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	– \$	1 \$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– \$	– \$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	– \$	2 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	19 \$	9 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3 \$	1 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1 \$	1 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	16 \$	11 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A ZAR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	152 \$	28 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	29 \$	20 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	– \$	– \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	9 \$	6 \$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	– \$	2 \$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^] – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– \$	– \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	109 \$	101 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	108 \$	91 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	42 \$	28 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	742 \$	552 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	325 \$	252 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	273 \$	112 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	159 \$	135 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	61 \$	29 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	11 \$	13 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	– \$	1 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	3 \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3 \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	434 \$	644 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	482 \$	578 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	55 \$	95 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (Monatlich) Abgesichert Plus	16 \$	24 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	125 \$	169 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	29 \$	33 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	20 \$	34 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	22 \$	41 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	60 \$	69 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	22 \$	29 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2 \$	3 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	4 \$	14 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	8 \$	24 \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.909 €	2.309 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	867 €	762 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	91 €	149 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus	121 €	127 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	156 €	256 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	– €	– €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus	965 \$	1.079 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1.335 \$	1.580 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	160 \$	228 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	38 \$	28 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	173 \$	190 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	122 \$	88 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	26 \$	57 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.363 \$	1.531 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S USD Ausschüttend (M) Plus	71 \$	116 \$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– €	3 \$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– €	1 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	7 \$	56 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5 \$	45 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– \$	5 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	4 \$	28 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– \$	1 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) Plus	8 \$	7 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	1 \$	1 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	– \$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	5 \$	14 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D HKD Ausschüttend (M) Plus	– \$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– \$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2 \$	7 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	4 \$	3 \$

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR.

Die von bestimmten Fonds angebotenen Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) Anteilsklassen können bestimmte Gebühren und Aufwendungen dem Kapital statt den Erträgen belasten. Die Anrechnung aller oder eines Teils der Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital führt zu einer Erhöhung der ausschüttungsfähigen Erträge; das Kapital, das diesen Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) für künftige Anlagen zur Verfügung steht, und das Kapitalwachstum können sich jedoch verringern. Anteilinhaber sollten beachten, dass ein erhöhtes Risiko besteht, dass sie bei der Rücknahme von Anteilen der Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) nicht den vollen investierten Betrag zurückerhalten. Für Anleger in den Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) kann dies dazu führen, dass die Kapitalanlage des Anlegers ungeachtet der Wertentwicklung des betreffenden Fonds oder der Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Anlage zuzurechnen sind, aufgezehrt wird, was den Wert künftiger Erträge wahrscheinlich schmälern wird. Die erhöhte Dividendenausschüttung infolge der Belastung des Kapitals mit Gebühren und Kosten kommt einer Rückgabe oder Rücknahme der ursprünglichen Kapitalanlage des Anlegers oder der dieser ursprünglichen Anlage zurechenbaren Kapitalgewinne gleich.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

5. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen – (Fortsetzung)

Die höhere Dividendenausschüttung im Rahmen dieses Anrechnungsmechanismus führt zu einem entsprechenden unmittelbaren Rückgang des Nettoinventarwerts der Anteilsklassen am Ex-Dividenden-Tag. Anteilsinhaber werden darauf hingewiesen, dass in dem Maße, in dem Aufwendungen dem Kapital belastet werden, einige oder alle Ausschüttungen der Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) als eine Form der Kapitalrückerstattung angesehen werden sollten. Alle Kosten der Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) wurden dem Kapital belastet.

Während des Geschäftsjahres haben die folgenden Fonds dem Kapital der Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) Gebühren und Kosten belastet:

	Dem Kapital belastete Gebühren und Aufwendungen für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	Dem Kapital belastete Gebühren und Aufwendungen für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3 \$	3 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1 \$	1 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse S USD Ausschüttend (M) Plus (e)	138 \$	44 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse S EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	24 \$	13 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse S GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	520 \$	834 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1.965 \$	2.562 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	221 \$	307 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	31 \$	56 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	136 \$	192 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A JPY Ausschüttend (M) Plus (e)	2 \$	3 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	374 \$	497 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	1 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	19 \$	42 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	87 \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	81 \$	110 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	201 \$	274 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1 \$	1 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	2 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	6 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1.265 \$	1.657 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	436 \$	446 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	82 \$	88 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	113 \$	157 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	99 \$	137 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	29 \$	52 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)	103 \$	104 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	226 \$	215 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17 \$	11 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse S EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	22 \$	25 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse S GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1 \$	2 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	231 \$	327 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	1 \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	125 \$	108 \$
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] – Klasse X GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] – Klasse S EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	2 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	5 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1 \$	– \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	37 €	133 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) Plus (e)	– €	38 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) ((abgesichert)) (PH) Plus (e)	383 €	453 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1.068 \$	1.433 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)	2 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse U EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse U GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)	3 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse U GBP Ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse U USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	17 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	69 \$	298 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	14 \$	18 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	3 \$	7 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	90 \$	117 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus (e)	8 \$	9 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse S GBP Ausschüttend (M) Plus (e)	3 \$	3 \$

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR.

Thesaurierende Anteilsklassen

In Bezug auf thesaurierende Anteilsklassen ist vorgesehen, dass im normalen Geschäftsverlauf keine Ausschüttungen beschlossen werden und dass die den thesaurierenden Anteilsklassen zuzurechnenden etwaigen Nettoanlageerträge täglich im Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Anteilsklasse kumuliert werden.

6. Grundkapital und rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile

Grundkapital

Die Gesellschaft wurde mit einem anfänglichen Grundkapital in Höhe von 39.000 Euro gegründet und durch 39.000 Zeichneranteile ohne Nennwert repräsentiert. Bis auf drei Ausnahmen wurden alle Zeichneranteile von der Gesellschaft zurückgekauft. Inhaber dieser drei Zeichneranteile sind zur Teilnahme und Ausübung ihres Stimmrechts bei allen Versammlungen der Gesellschaft berechtigt, jedoch nicht zum Bezug von Dividenden oder zur Beteiligung am Nettovermögen eines Fonds oder der Gesellschaft.

Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile

Das Grundkapital der Gesellschaft entspricht zu jeder Zeit dem Nettoinventarwert. Der Verwaltungsrat ist ermächtigt, bis zu fünfhundert Milliarden nennwertlose Anteile der Gesellschaft zum Nettoinventarwert pro Anteil zu den von ihm festgelegten Bedingungen auszugeben. Bei der Emission von Anteilen an der Gesellschaft besteht kein Vorkaufsrecht.

Jeder Anteil berechtigt den Anteilsinhaber zu einer gleichen, verhältnismäßigen Beteiligung an den Dividenden, sofern relevant, und dem Nettovermögen des jeweiligen Fonds, in Bezug auf den diese Anteile ausgegeben wurden. Ausgenommen hiervon sind Dividenden, die bereits beschlossen wurden, bevor dieser Anteilsinhaber wurde.

Der Erlös aus der Ausgabe von Anteilen wird in den Büchern der Gesellschaft dem betreffenden Fonds zugeschrieben und im Namen des Fonds zum Erwerb von Vermögenswerten verwendet, in die der Fonds investieren kann. Die Unterlagen und Bücher der einzelnen Fonds werden getrennt geführt.

Für jeden Fonds werden verschiedene Anteilsklassen angeboten, wie im Prospekt der Gesellschaft angegeben. Diese verschiedenen Anteilsklassen unterscheiden sich vor allem in Bezug auf ihre Ausgabeaufschläge, Gebühren, Kostensätze, Ausschüttungspolitik und Währung. Anleger können somit eine Anteilsklasse wählen, die ihren Anlagebedürfnissen am besten entspricht, unter Berücksichtigung der Höhe der Anlage und der voraussichtlichen Haltedauer.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

6. Grundkapital und rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile – (Fortsetzung)

Jede Anteilsklasse wird als ausschüttende Anteilsklasse oder als thesaurierende Anteilsklasse bezeichnet. Thesaurierende Anteilsklassen schütten keine Nettoerträge, realisierten oder nicht realisierten Nettokapitalgewinne aus, während ausschüttende Anteilsklassen in bestimmten Abständen Ausschüttungen vornehmen, die je nach dem Buchstaben in Klammern am Ende des Namens der ausschüttenden Anteilsklasse variieren (siehe Erläuterung 5 – Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile). Darüber hinaus hat die Gesellschaft Zeichneranteile im Umlauf. Die Zeichneranteile berechnen die Inhaber nicht zur Beteiligung am Vermögen eines Fonds.

Jeder Teilfonds kann Anteilsklassen anbieten, die auf andere Währungen als die Basiswährung des Fonds lauten. Für jede derartige Anteilsklasse werden der betreffende Anlageverwalter und der Unteranlageverwalter keine Techniken zur Absicherung des Risikos der Anteilsklasse in Bezug auf Wechselkursänderungen zwischen der Basiswährung des Fonds und der Währung der Anteilsklasse anwenden, es sei denn, dies ist im Namen der Anteilsklasse mit „(abgesichert)“ angegeben.

Anteile der Klasse A stehen allen Anlegern zur Verfügung. Provisions-/Rückvergütungszahlungen können von Vertriebsstellen an Händler oder andere Anleger geleistet werden, die eine Vereinbarung mit einer Vertriebsstelle in Bezug auf diese Anteile getroffen haben. Anteile der Klassen B, C, D, E und K stehen allen Anlegern zur Verfügung, die Kunden von Händlern sind, die von einer Vertriebsstelle in Bezug auf diese Anteile bestellt wurden. Provisionszahlungen können von Vertriebsstellen an Händler oder andere Anleger geleistet werden, die eine Vereinbarung mit einer Vertriebsstelle in Bezug auf diese Aktien getroffen haben. Anteile der Klasse F stehen professionellen Anlegern und Anlegern zur Verfügung, die mit einem von der Vertriebsstelle bestellten Händler eine Vereinbarung über die Anlage dieser Anteile nach eigenem Ermessen getroffen haben. Provisions-/Rückvergütungszahlungen können von Vertriebsstellen an Händler oder andere Anleger geleistet werden, die mit der Vertriebsstelle eine Vereinbarung in Bezug auf diese Aktien getroffen haben. Anteile der Klasse J sind für den Vertrieb in Japan bestimmt, der im Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen liegt. Anteile der Klasse M stehen professionellen Anlegern und Anlegern zur Verfügung, die mit einem Händler oder einer anderen von der Vertriebsstelle für diese Anteile bestellten Stelle eine Vereinbarung über die Anlage nach eigenem Ermessen getroffen haben. Anteile der Klasse R stehen allen Anlegern zur Verfügung, die eine gebührenbasierte Vereinbarung mit einem Vermittler getroffen haben, von dem sie eine persönliche Empfehlung in Bezug auf ihre Anlage in den Fonds erhalten haben. Anteile der Klasse T sind für den Vertrieb in Taiwan bestimmt, der im Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen liegt. Anteile der Klasse X stehen Händlern, Portfoliomanagern oder Plattformen zur Verfügung, die gemäß den aufsichtsrechtlichen Bestimmungen oder aufgrund von Gebührenvereinbarungen mit ihren Kunden keine Vertriebsprovisionen annehmen und einbehalten dürfen, sowie institutionellen Anlegern (für Anleger in der Europäischen Union bedeutet dies „zulässige Gegenparteien“ im Sinne von MIFID II), die für eigene Rechnung investieren. Die Anteilsklassen U, Y und S stehen institutionellen Anlegern nach Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen zur Verfügung. BW LM-Anteilsklassen stehen im Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen qualifizierten Anlegern zur Verfügung, die Unternehmen der Franklin Templeton-Gruppe sind oder Kunden dieser Unternehmen sind. LM-Anteilsklassen stehen im Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen qualifizierten Anlegern zur Verfügung, die Unternehmen der Franklin Templeton-Gruppe, Altersversorgungssysteme und ähnliche Systeme, die von Unternehmen der Franklin Templeton-Gruppe oder Kunden dieser Unternehmen gesponsert werden, sind. Für Anleger mit Sitz in der Europäischen Union sind BW Premier-Anteilsklassen nach dem Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen für „zulässige Gegenparteien“ im Sinne von MIFID II erhältlich; für Anleger mit Sitz außerhalb der Europäischen Union sind BW Premier-Anteilsklassen nach dem Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen für institutionelle Anleger oder für qualifizierte Anleger erhältlich, die Unternehmen der Franklin Templeton-Gruppe oder Kunden dieser Unternehmen sind. Für Anleger mit Sitz in der Europäischen Union sind Premier-Anteilsklassen für „zulässige Gegenparteien“ im Sinne von MIFID II verfügbar; für Anleger mit Sitz außerhalb der Europäischen Union sind Premier-Anteilsklassen für institutionelle Anleger verfügbar.

Für Anteilsklassen, die in ihrem Namen nach der Währungsbezeichnung den Zusatz „(abgesichert)“ enthalten, ist vorgesehen, dass diese Anteilsklassen gegen Wechselkursschwankungen zwischen der Währung der Anteilsklasse und der Basiswährung des betreffenden Fonds abgesichert sind. Bestimmte Anteilsklassen von Fonds, die von Brandywine Global Investment Management, LLC, verwaltet werden, sind gegenüber einem Index abgesichert, was durch „(IH)“ im Namen der Anteilsklasse angezeigt wird. Die von Brandywine Global Investment Management, LLC, verwalteten Fonds und der von ClearBridge Investments (North America) Pty Limited verwaltete FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund bieten portfoliogesicherte Anteilsklassen an, was durch „(PH)“ im Namen der Anteilsklasse angezeigt wird. Bestimmte Fonds bieten Anteilsklassen an, die eine Performancegebühr zahlen können, was durch „(PF)“ im Namen der Anteilsklasse angezeigt wird.

Bestimmte Fonds haben auch Anteile von Grandfathered-Anteilsklassen ausgegeben, was durch „GA“, „GE“, „GP“ oder „(G)“ im Namen der Anteilsklasse angezeigt wird. Die Grandfathered-Anteilsklassen sind nur für Anteilsinhaber der verbundenen Fonds verfügbar. Die Anteile der Grandfathered-Anteilsklassen sind für weitere Zeichnungen sowohl durch bestehende Anteilseigner der Anteilsklasse als auch durch neue Anleger geschlossen, mit der Ausnahme, dass Anteile weiterhin durch (1) die Wiederanlage von Dividenden, (2) den automatischen Umtausch von einer Anteilsklasse der Klasse B (G) des Fonds in eine Anteilsklasse der Klasse A (G) desselben Fonds und (3) den Umtausch von Anteilen einer Grandfathered-Anteilsklasse mit derselben Buchstabenbezeichnung erworben werden können. Ungeachtet des Vorstehenden können, wie in den Fondsnachträgen angegeben, bestimmte Grandfathered-Anteilsklassen für bestimmte Fonds im alleinigen Ermessen des Verwaltungsrats für spätere Zeichnungen durch bestehende Anteilsinhaber der Anteilsklasse zur Verfügung gestellt werden.

7. Besteuerung

Gemäß aktuellem Recht und aktueller Praxis in Irland erfüllt die Gesellschaft die Voraussetzungen für einen Investmentfonds gemäß Abschnitt 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 (in seiner jeweils gültigen Fassung). Auf dieser Basis sind die Erträge und Gewinne der Gesellschaft außer bei Eintreten eines Steuertatbestandes in Irland generell nicht steuerpflichtig. Ein Steuertatbestand entsteht im Allgemeinen bei der Ausschüttung, Rücknahme, dem Rückkauf, der Einziehung oder Übertragung von Anteilen oder am Ende des „relevanten Zeitraums“. Dieser bezeichnet den achtjährigen Zeitraum, der mit dem Kauf der Anteile durch die Anteilsinhaber beginnt, und jeden nachfolgenden achtjährigen Zeitraum, der sich unmittelbar an den vorherigen relevanten Zeitraum anschließt.

Die Gesellschaft wird bei Eintreten eines Steuertatbestandes nicht in Irland steuerpflichtig, wenn:

- (i) ein Anteilsinhaber zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses steuerlich weder in Irland ansässig ist noch seinen gewöhnlichen Wohnsitz dort hat, sofern eine gültige angemessene Erklärung vorliegt oder sofern der Gesellschaft von Irish Revenue gestattet wurde, Bruttozahlungen zu leisten, wenn keine angemessenen Erklärungen vorliegen; und
- (ii) bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anteilsinhaber der Gesellschaft die notwendigen unterzeichneten eidesstattlichen Erklärungen vorgelegt haben.

Darüber hinaus stellen jegliche Transaktionen (bei denen es sich andernfalls um ein steuerpflichtiges Ereignis handeln könnte) in Bezug auf Anteile, die in einem laut Verordnung der irischen Steuerbehörde anerkannten Clearingsystem gehalten werden, keine steuerpflichtigen Ereignisse dar.

Sofern keine entsprechende Erklärung vorliegt, ist die Gesellschaft bei Eintreten eines Steuertatbestandes in Irland steuerpflichtig.

Erhaltene Kapitalerträge, Dividenden und Zinsen können im Herkunftsland Steuern, einschließlich Quellensteuern, unterliegen, und der Fonds oder seine Anteilsinhaber bekommen diese Steuern eventuell nicht erstattet.

8. Barmittel und Barmitteläquivalente und Margenkonten

Barmittel und andere liquide Mittel werden zum Nennwert und gegebenenfalls unter Berücksichtigung aufgelaufener Zinsen bewertet. Die Barmittel und Barmitteläquivalente und Barmittel-Überziehungssalden eines Fonds werden bei der Depotstelle gehalten. „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ in der Bilanz umfassen Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus noch nicht gelieferten Futures-Kontrakten. Am 29. Februar 2024 und am 28. Februar 2023 wurden Einschusszahlungen und Barsicherheiten in Bezug auf den Handel mit OTC- und börsengehandelten Derivaten bei den folgenden Brokern gehalten: Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS.

9. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 29. Februar 2024 bzw. 28. Februar 2023 bestanden keine wesentlichen Verbindlichkeiten oder Eventualverbindlichkeiten.

10. Soft-Commission-Vereinbarungen

Die Gesellschaft verfügt über Richtlinien, die sicherstellen sollen, dass ihre Dienstleister im besten Interesse der Fonds handeln, wenn sie im Rahmen der Verwaltung der Portfolios der Fonds Entscheidungen über Geschäfte im Namen dieser Fonds treffen. Zu diesem Zweck müssen alle angemessenen Schritte unternommen werden, um das bestmögliche Ergebnis für die Fonds zu erzielen, wobei Preis, Kosten, Schnelligkeit, Wahrscheinlichkeit der Ausführung und Abwicklung, Umfang und Art des Auftrags oder andere für die Ausführung des Auftrags relevante Faktoren zu berücksichtigen sind. Alle Barrabatte, die von einem Makler oder Händler als Gegenleistung für an diesen Broker oder Händler gerichtete Brokertransaktionen des Fonds erhalten werden, werden nicht vom Anlageverwalter, dem Unteranlageverwalter oder einer ihrer verbundenen Personen einbehalten. Die Gesellschaft trägt nicht die Kosten für externes Research, das von den Anlageverwaltern und Unteranlageverwaltern eingeholt wird. Diese Kosten werden von dem jeweiligen Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter getragen. Informationen über die Ausführungsrichtlinien der Fonds stehen den Anteilsinhabern auf Anfrage kostenlos zur Verfügung.

In den Geschäftsjahren zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 schloss Royce & Associates, LP („Royce“) Soft-Commission-Vereinbarungen mit Brokern, erstattete den betreffenden Fonds jedoch die im Rahmen dieser Vereinbarungen angefallenen Research-Kosten.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Wechselkurse

Die folgenden Wechselkurse wurden in diesem Jahresabschluss verwendet, um die entsprechenden Beträge in US-Dollar, Euro und britischem Pfund für die jeweiligen Fonds mit auf US-Dollar, Euro und britischem Pfund basierenden Währungen zu ermitteln:

	Währung	Wechselkurse zum 29. Februar 2024	Wechselkurse zum 28. Februar 2023
Auf USD lautende Fonds	Argentinischer Peso	1.059,2180*	366,3138
	Australischer Dollar	1,5385	1,4861
	Brasilianischer Real	4,9711	5,2355
	Britisches Pfund	0,7922	0,8314
	Kanadischer Dollar	1,3572	1,3645
	Chinesischer Renminbi (CNH)	7,2064	6,9499
	Chinesischer Renminbi (CNY)	7,1933	6,9394
	Kolumbianischer Peso	3.925,0000	4.859,4300
	Tschechische Krone	23,4451	22,2152
	Dänische Krone	6,8965	7,0371
	Dominik. Peso	58,6500	/
	Ägyptisches Pfund	42,2500	30,6300
	Euro	0,9252	0,9454
	Hongkong-Dollar	7,8295	7,8494
	Ungarischer Forint	363,2263	/
	Indische Rupie	82,9163	82,6675
	Indonesische Rupiah	15.715,0000	15.250,0000
	Israelischer Sichel	/	3,6534
	Jamaika-Dollar	155,9966	/
	Japanischer Yen	149,9200	136,1550
	Malaysischer Ringgit	4,7455	4,4875
	Mexikanischer Peso	17,0443	18,2965
	Neuseeland-Dollar	1,6424	1,6173
	Norwegische Krone	10,6213	10,3848
	Pakistan Rupie	/	261,5000
	Peruanischer Nuevo Sol	/	3,7949
	Philippinischer Peso	56,2150	55,3500
	Polnischer Zloty	3,9931	4,4486
	Russischer Rubel	91,5000	75,0500
	Saudi-Rial	3,7503	3,7527
	Singapur-Dollar	1,3456	1,3485
	Südafrikanischer Rand	19,1800	18,3650
	Südkoreanischer Won	1.331,6000	1.323,2500
	Schwedische Krone	10,3664	10,4680
	Schweizer Franken	0,8844	0,9419
	Taiwan-Dollar	31,6095	30,4695
	Thailändischer Baht	35,8650	35,3413
	Türkische Lira	31,2315	18,8850
	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	3,6730	/
	Uruguayischer Peso	39,1450	/
Auf EUR lautende Fonds	Australischer Dollar	1,6628	1,5719
	Brasilianischer Real	5,3728	5,5375
	Britisches Pfund	0,8562	0,8793
	Kanadischer Dollar	1,4668	1,4432
	Dänische Krone	7,4537	7,4431
	Japanischer Yen	162,0336	144,0112
	Norwegische Krone	11,4795	/
	Polnischer Zloty	4,3157	4,7052
	Südafrikanischer Rand	20,7298	19,4247
	Schwedische Krone	11,2040	11,0720
	Schweizer Franken	0,9558	0,9962
	US-Dollar	1,0808	1,0577
	Auf GBP lautende Fonds	Euro	/
Japanischer Yen		/	163,7741
US-Dollar		1,2623	1,2029

* Abgezinsten Tagessatz, basierend auf dem ARS Eqy EqWgt Impli (UNOFFICIAL) Index, gemäß den Anweisungen von FTIS.

12. Risikoexposition und Risikomanagement

Nach seiner Ernennung zur OGAW-Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft, mit Verantwortung für die Verwaltung der Gesellschaft und für bestimmtes Investment Management, Verwaltungs- und Vertriebsfunktionen in Bezug auf das Unternehmen, wie in den UCITS Regulations dargelegt, hat FTIS (der „Manager“) die Entscheidung getroffen, einige, aber nicht alle Aktivitäten im Bereich der Anlageverwaltung an relevante Anlageverwalter und/oder Teilanlageverwalter zu delegieren, vorausgesetzt, dass der Manager den Fonds gegenüber für die Erfüllung ihrer vereinbarten Verpflichtungen verantwortlich bleibt (auf den Seiten „Allgemeine Informationen“ sind die Anlageverwalter und Unteranlageverwalter für die einzelnen Fonds gemäß Prospekt genannt).

Gemeinsam mit dem Manager und den Anlageverwaltern hat die Gesellschaft unter anderem das Marktrisiko, das Kreditrisiko und das Liquiditätsrisiko als für sie wesentliche Risiken definiert. Bei der Verwendung von Finanzderivaten bestehen die Risiken im Gegenpartierisiko, im Kreditrisiko, in erhöhten Nachschussforderungen und im unbegrenzten Verlustrisiko. Nähere Einzelheiten zu diesen und anderen Risiken sind weiter unten aufgeführt und können dem Abschnitt „Risikofaktoren“ im Verkaufsprospekt entnommen werden.

Das Marktrisiko beinhaltet das Marktpreis-, das Fremdwährungs- und das Zinsrisiko sowie andere Preisrisiken.

Das Marktpreisrisiko bezeichnet das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert künftiger Kapitalströme eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Kurse am Markt schwanken wird. Das maximale Preisrisiko, das sich aus dem Eigentum an Finanzinstrumenten ergibt, bestimmt sich aus dem beizulegenden Zeitwert der Finanzinstrumente. Die Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter können das mit bestimmten Ländern, Branchen oder Wertpapieren verbundene Risiko über die Vermögensaufteilung der Portfolios steuern. Dabei ist jedoch das Anlageziel des jeweiligen Fonds, wie im Fondsnachtrag zum Prospekt angegeben, zu beachten. Der jeweilige Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter steuert das Risiko, indem er Wertpapiere und andere Finanzinstrumente innerhalb bestimmter Anlagegrenzen und im Rahmen der Anlagemandate sorgfältig auswählt. Einzelheiten zur Anlagepolitik der einzelnen Fonds sind in dem entsprechenden Nachtrag zum Prospekt enthalten. Einzelheiten zu den finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds sind in der Bilanz dargestellt.

Das Fremdwährungsrisiko bezeichnet das Risiko, dass der Wert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen des Wechselkurses zwischen der Währung, auf die der finanzielle Vermögenswert oder die finanzielle Verbindlichkeit lautet, und der Leitwährung des Fonds schwanken wird. Der Wert der auf eine andere Währung als die Leitwährung lautenden Anlagen eines Fonds kann aufgrund von Wechselkursschwankungen bei den maßgeblichen Währungen steigen oder fallen. Größere Wechselkursschwankungen können sich durchaus erheblich auf die Wertentwicklung der Fonds auswirken.

Wenn ein Fonds Anlagen in einer anderen Währung als der Leitwährung des Fonds hält, kann der betreffende Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter das Fremdwährungsrisiko entweder durch Absicherung der Fremdwährung in die Leitwährung des Fonds oder alternativ durch Diversifizierung der Anlagen über mehrere Währungen unter Nutzung eines Multibanken-Devisenhandelsnetzes steuern.

Das Zinsrisiko bezeichnet das Risiko, dass der Wert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen des Marktzinssatzes schwanken wird. Die Fonds, die festverzinsliche Schuldtitel und Überziehungspositionen halten, sind einem Zinsrisiko ausgesetzt, wenn der Wert dieser Wertpapiere oder Kredite infolge einer Änderung der Zinssätze schwankt. Beteiligungen an variabel verzinslichen Wertpapieren können ebenfalls einem Zinsrisiko unterliegen, wenngleich in geringerem Umfang. Von der Verwahrstelle verwaltete Barmittel können Zinseinnahmen generieren, deren Höhe je nach den aktuellen Marktzinssätzen schwankt.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

Die Aktienfonds legen generell nicht in zinstragenden Wertpapieren an. Ausgenommen hiervon sind die von der Verwahrstelle gehaltenen Barbestände. Bargeldanlagen werfen Zinserträge ab, deren Höhe je nach Marktzinsniveau schwankt. Infolgedessen unterliegen die Aktienfonds keinem nennenswerten Risiko aufgrund von Schwankungen der Marktzinssätze für ihre finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten.

Die Rentenfonds und die Multi-Asset-Fonds legen allgemein in zinstragenden finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten an. Daher unterliegen sie den Risiken, die mit den Auswirkungen von Schwankungen der aktuellen Marktzinsen auf ihre Finanzpositionen und Kapitalströme verbunden sind. Der Wert von Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren kann aufgrund von Zinsänderungen schwanken. Schwankungen der Marktzinsen wirken sich auf die Höhe der Zinseinnahmen eines Fonds aus.

Bei steigenden Zinsen verringert sich im Allgemeinen der Wert von emittierten und im Umlauf befindlichen Schuldtiteln, während bei sinkenden Zinsen der Wert von emittierten und im Umlauf befindlichen Schuldtiteln in der Regel steigt. Die Spanne dieser Kursschwankungen ist umso größer, je länger die Restlaufzeit der im Umlauf befindlichen Wertpapiere ist. Ändert sich der Wert der von einem Fonds gehaltenen Wertpapiere bei Zinsänderungen, bedeutet dies, dass der Nettoinventarwert je Anteil aufgrund der Auswirkung auf den Wert des aus Schuldtiteln bestehenden Fondsportfolios sinken oder steigen kann.

Der Manager eines jeden Rentenfonds überwacht das Zinsumfeld und bewertet die Risiken der wichtigsten Strategien. Das Zinsrisiko wird durch die Überwachung der Laufzeiten und der Duration im Verhältnis zu den Benchmarks der Fonds gesteuert. Zur Bewertung des Portfolio-Kurvenexposition werden Methoden wie die Messung der Leitzinsduration angewendet.

Einzelheiten zu den gewichteten Durchschnittsrenditen der einzelnen Rentenfonds, den gewichteten durchschnittlichen Restlaufzeiten und der Verteilung der festverzinslichen und unverzinslichen Wertpapiere sind in den Erläuterungen 12.1(b) und 12.1(c) unten aufgeführt.

Zu den Risiken, die mit einer Anlage in Aktienfonds verbunden sind, gehören sich ändernde wirtschaftliche Bedingungen, Branchen- und Unternehmensbedingungen sowie die Auswahl der Wertpapiere. Rentenfund Multi-Asset-Fonds unterliegen auch dem Zinsrisiko, dem Kreditrisiko, dem Fälligkeitsrisiko und dem Marktrisiko. Internationale Wertpapiere unterliegen Veränderungen der Wechselkurse, weniger liquiden Märkten und je nach Land politischer und wirtschaftlicher Instabilität. Die Märkte der Entwicklungsländer sind den gleichen Risiken ausgesetzt, wenn auch mitunter in stärkerem Maße. Zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements können die Fonds börsengehandelte oder außerbörslich gehandelte („OTC“) Derivate abschließen, unter anderem Futures, Swaps, Termingeschäfte, Optionen und Optionsscheine, und sie können Aktienleihverträge schließen.

Der Ausschuss für Anlagemanagement und Portfolioaufsicht („IMPOC“ oder der „Ausschuss“) wurde innerhalb von Franklin Templeton eingerichtet, um die Delegation der Verantwortlichkeiten des Anlagemanagements für alle Fonds zu beaufsichtigen. Dieser Ausschuss besteht aus Personen, die als Gruppe über Erfahrungen und spezielles Know-how in Bereichen wie Anlageverwaltung (z. B. Aktien, Anleihen und Derivate), Wertpapieranalyse und Reporting, Risikomanagement sowie Compliance verfügen. Der Ausschuss ist im Namen des Managers dafür verantwortlich, zu überwachen, dass die Fonds in Übereinstimmung mit dem im Verkaufsprospekt und den OGAW-Verordnungen enthaltenen Bestimmungen zu Anlagerichtlinien und -beschränkungen für die Fonds sowie gemäß den internen Anlagerichtlinien und -beschränkungen des jeweiligen Anlageverwalters oder Unteranlageverwalters verwaltet werden. Im Allgemeinen kommt der Ausschuss einmal monatlich zusammen, um zu überwachen, dass die Fonds in Übereinstimmung mit diesen Beschränkungen und Vorschriften verwaltet werden.

Die jeweiligen Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter erstatten dem Ausschuss Bericht über Angelegenheiten, die sich im Zusammenhang mit der Überwachung bestimmter wesentlicher Risiken ergeben, die mit den Anlagen eines Fonds in Finanzinstrumente verbunden sind.

12.1 Marktrisiko

Jeder Fonds, der Finanzderivate einsetzt, ist bestrebt, das Marktrisiko und die Hebelwirkung, die durch den Einsatz von Derivaten entstehen, zu begrenzen, indem er entweder den Commitment-Ansatz oder ein komplexes Verfahren zur Risikomessung („Value-at-Risk“- bzw. „VaR“-Ansatz) anwendet. Jeder Fonds, der Finanzderivate einsetzt (ausgenommen der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]) wenden den Commitment-Ansatz an. Der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] wenden den VaR-Ansatz an.

Der Manager wendet einen Risikomanagementprozess an, damit sie die Risiken in Verbindung mit Finanzderivate-Positionen genau messen, überwachen und steuern kann.

Der Commitment-Ansatz berechnet den Hebel, indem der Marktwert der zugrunde liegenden Derivate-Exposures im Verhältnis zum jeweiligen Fonds-Nettoinventarwert ermittelt wird. Der VaR-Ansatz ist ein statistisches Verfahren, das unter Zugrundelegung historischer Daten mit einem bestimmten Konfidenzniveau (z. B. „einseitig“ 99 %) prognostiziert, wie hoch der wahrscheinliche maximale Verlust eines Fonds sein wird. Der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund[^], FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] wenden ein „absolutes“ VaR-Modell an, bei dem die VaR-Messung im Verhältnis zum Nettoinventarwert des Fonds vorgenommen wird. Ein VaR-Modell hat bestimmte inhärente Beschränkungen und kann nicht zuverlässig prognostizieren und garantieren, dass der Umfang oder die Häufigkeit von Verlusten, die ein Fonds erleidet, in irgendeiner Weise begrenzt wird. Da sich das VaR-Modell auf historische Marktdaten als einen seiner wichtigsten Inputs stützt, kann die Wirksamkeit des VaR-Modells bei der Vorhersage des VaR eines Fonds erheblich beeinträchtigt werden, wenn die aktuellen Marktbedingungen von denen des historischen Beobachtungszeitraums abweichen. Unter anormalen Marktbedingungen kann dies für die Anleger schwerwiegende finanzielle Folgen haben.

Die Wirksamkeit des VaR-Modells könnte in ähnlicher Weise beeinträchtigt werden, wenn sich andere im VaR-Modell enthaltene Annahmen oder Bestandteile als unzureichend oder falsch erweisen.

Western Asset Management Company Limited und Western Asset Management Company, LLC („Western Asset“) berechnen den VaR mit einem Konfidenzniveau von 99 % für einen Zeithorizont von 1 Tag unter Verwendung einer geeigneten Stichprobe historischer Daten. Die nachstehende Tabelle gibt den absoluten VaR für die Fonds an:

Fonds	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	2,36 %	2,48 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	1,10 %	1,38 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	0,81 %	0,62 %
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	1,47 %	1,64 %

Brandywine Global Investment Management, LLC („Brandywine“) berechnet den VaR mit einem Konfidenzniveau von 95 % für einen Zeithorizont von 1 Tag unter Verwendung von historischen Daten aus 2 Jahren. Die nachstehende Tabelle gibt den absoluten VaR für die Fonds an:

Fonds	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	0,77 %	1,06 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	0,62 %	1,11 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	0,50 %	0,47 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	1,23 %	1,68 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	0,61 %	1,11 %

Wenn der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] ein absolutes VaR-Modell verwenden, unterliegt jeder dieser Fonds gemäß den Vorschriften der Zentralbank einem absoluten VaR-Limit von 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds. Jeder dieser Fonds kann jedoch von Zeit zu Zeit eine Veränderung des Nettoinventarwerts über einen Zeitraum von 20 Tagen erfahren, die 20 % des Nettoinventarwerts übersteigt.

Zusätzlich zur Anwendung des VaR-Ansatzes überwacht der Manager des FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] die Hebelwirkung täglich, um Veränderungen aufgrund von Marktbewegungen zu verfolgen. Darüber hinaus führen die jeweiligen Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter jedes dieser Fonds im Vorfeld von Transaktionen Tests durch, um zu prüfen, wie sich die Transaktion auf die Gesamthebelwirkung des betreffenden Fonds auswirken würde, und um dem Risiko-Ertrags-Verhältnis der Transaktion Rechnung zu tragen.

Die niedrigsten, durchschnittlichen und höchsten VaR-Werte bei einem Konfidenzniveau von 99 % und einem Zeithorizont von 20 Tagen für die relevanten Fonds von Western Asset und Brandywine waren wie folgt:

Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024

Fonds	Minimum	Durchschnitt	Maximum
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	7,65 %	12,29 %	19,71 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	4,88 %	5,71 %	7,25 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	2,52 %	3,25 %	5,16 %
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	4,55 %	7,71 %	9,37 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	4,77 %	5,59 %	7,45 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	3,87 %	5,10 %	5,84 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	2,11 %	4,52 %	8,80 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	7,64 %	8,23 %	8,83 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	3,39 %	4,51 %	5,24 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023

Fonds	Minimum	Durchschnitt	Maximum
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	5,88 %	9,42 %	13,64 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	3,67 %	5,96 %	10,72 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	2,19 %	3,38 %	4,80 %
Western Asset SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	5,02 %	8,46 %	13,23 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	1,70 %	3,78 %	6,70 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	1,93 %	4,17 %	6,99 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	1,77 %	3,20 %	5,69 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	6,67 %	8,75 %	10,62 %
FTGF Global Multi-Sector Impact Fund [^]	1,59 %	4,30 %	5,04 %

Bei Fonds, die den VaR verwenden, wird die Hebelwirkung als Summe der Nominalwerte der eingesetzten Derivate berechnet.

Die durchschnittliche Hebelwirkung war wie folgt:

Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	1.522,96 %	1.555,99 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	95,37 %	132,04 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	24,33 %	34,70 %
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	415,50 %	415,50 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	191,10 %	216,30 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	64,20 %	107,40 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	72,85 %	98,80 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	130,53 %	222,50 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	74,62 %	87,00 %

Bei Stresstests werden die potenziellen Auswirkungen einer Reihe spezifischer Änderungen von Risikofaktoren, die sich auf außergewöhnliche, aber mögliche Ereignisse beziehen, auf die Finanzlage eines Fonds untersucht. Western Asset wendet einen konservativen Ansatz an, indem Stresstests durchgeführt werden, die über den Bereich der vernünftigerweise wahrscheinlichen Ereignisse hinausgehen. Western Asset geht davon aus (obwohl es keine Garantie dafür gibt), dass der Nettoinventarwert je Anteil (oder einer bestimmten Anteilsklasse) dieses Fonds im Falle negativer Marktereignisse stabil bleibt, wenn der FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund Stresstests standhält, die außerhalb des Bereichs der vernünftigerweise wahrscheinlichen Ereignisse liegen.

Ein szenariobasierter Stresstest kann durchgeführt werden, um die Anforderungen von FRS 102 hinsichtlich der Sensitivitätsanalyse zu erfüllen. FRS 102 schreibt für Sensitivitätsanalysen keine spezifische Basispunktbewegung oder prozentuale Bewegung vor. Dementsprechend wird für die Zwecke dieses Jahresberichts die Währungsauswirkung eines spontanen Anstiegs der kurzfristigen Zinssätze um 25 Basispunkte auf den FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund angegeben:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund
Zum 29. Februar 2024	-223.701 \$
Zum 28. Februar 2023	-62.727 \$

(a) Marktpreisrisiko

Das Marktpreisrisiko jedes Fonds in Bezug auf einen Index wird überwacht, jedoch nicht gemanagt. Die Indizes zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 sind nachstehend aufgeführt.

Die folgenden Tabellen enthalten den Index für jeden Teilfonds mit Ausnahme des FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] und quantifizieren die wahrscheinlichen Auswirkungen auf den Wert des Nettoinventarwerts für jeden Fonds auf der Grundlage einer positiven und negativen Entwicklung des Index, einschließlich des 1-Jahres-Beta für jeden Fonds. Beta ist ein Maß für die Volatilität der Bestände eines Fonds im Verhältnis zum Markt oder Index. Das Beta ist zwar ein klares, quantifizierbares Maß, berücksichtigt aber keine neuen Informationen, und vergangene Kursbewegungen sind keine genauen Vorhersagen für die Zukunft.

Zum 29. Februar 2024

Fonds	Index	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Veränderungen im Index (in Tsd.)	
			Positiv 5 % *	Negativ 5 % *
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Treasury Bill 1-Month	USD	-10.180	10.180
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	11.022	-11.022
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	50.192	-50.192
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	FTSE Euro Broad Investment-Grade Bond Index	EUR	2.988	-2.988
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity	USD	258.671	-258.671
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2% Issuer Capped	USD	4.844	-4.844
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Bloomberg Global High Yield Index Currency Hedged (USD)	USD	2.912	-2.912
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	12.363	-12.363
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund **	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Years Index	USD	16.291	-16.291
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Index Currency Hedged (USD)	USD	9.585	-9.585
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Credit Index Currency Hedged (USD)	USD	1.328	-1.328
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Bloomberg U.S. Mortgage Backed Securities Index	USD	55.874	-55.874
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	11.323	-11.323
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Bloomberg Global High Yield Index	USD	1.321	-1.321
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	16.124	-16.124
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^] ***	Bloomberg U.S. Aggregate	USD	/	/
FTGF ClearBridge Value Fund	Russell 1000 Value Index	USD	60.956	-60.956
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	S&P 500 Index	USD	8.644	-8.644
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	94.800	-94.800
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Russell 3000 Growth Index	USD	9.027	-9.027
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones U.S. Select Dividend Index (Total)	USD	1.264	-1.264
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Russell 3000 Index	USD	71.499	-71.499
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	MSCI AC World Net Index	USD	859	-859
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	OECD G7 CPI + 5.5%. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	EUR	42.112	-42.112
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	OECD G7 CPI + 5.5%. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	USD	7.715	-7.715
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^] ***	MSCI World Value Net Index	USD	/	/
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Value Index	USD	32.566	-32.566
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	4.581	-4.581

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(a) Marktpreisrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Fonds	Index	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Veränderungen im Index (in Tsd.)	
			Positiv 5 %*	Negativ 5 %*
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	MSCI AC World Index Small Cap Net Index	USD	233	-233
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	MSCI AC World Net Index	USD	8.500	-8.500
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	50% MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Equity REITS Net Index /50% MSCI AC Asia Pacific Ex Japan/UTILITIES Net Index	USD	948	-948
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	MSCI Emerging Markets Net Index	USD	1.714	-1.714
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	MSCI Europe Net Index	EUR	13.292	-13.292
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^] ***	Benchmark nicht verfügbar	USD	/	/
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^] **	30% Bloomberg Euro High Yield 3-5 Yr + 70% Bloomberg Euro Corporate 3-5 Yr	EUR	4325	-4.325

* Das wahrscheinlichste Ergebnis beruht auf einer um 5 % über- oder unterdurchschnittlichen Performance gegenüber der tatsächlichen Performance der Benchmark.

** Der Fonds hat keinen Index als Benchmark, daher wurde ein Ersatzindex als Indikator für die Beta-Berechnung verwendet.

*** Der Fonds hat keine 1-Jahres-Performance; daher ist für den Fonds kein Beta verfügbar.

Zum 28. Februar 2023

Fonds	Index	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Veränderungen im Index (in Tsd.)	
			Positiv 5 %*	Negativ 5 %*
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Treasury Bill 1-Month (USD)	USD	26.917	-26.917
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	8.535	-8.535
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	76.497	-76.497
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	FTSE Euro Broad Investment-Grade Bond Index	EUR	7.320	-7.320
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity	USD	533.447	-533.447
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2% Issuer Capped	USD	6.239	-6.239
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Bloomberg Global High Yield Index Currency Hedged (USD)	USD	3.132	-3.132
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	20.499	-20.499
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund**	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Years Index	USD	25.905	-25.905
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Index Currency Hedged (USD)	USD	9.824	-9.824
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Credit Index Currency Hedged (USD)	USD	2.680	-2.680
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Bloomberg U.S. Mortgage Backed Securities Index	USD	57.923	-57.923
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	ICE Bank of America Merrill Lynch Sterling Non-Gilt Index Gross Dividends (GBP)	GBP	2.438	-2.438
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Bloomberg U.S. Credit Index	USD	5.237	-5.237
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate – Corporate Index Currency Hedged (USD)	USD	488	-488
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	11.449	-11.449
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Bloomberg Global High Yield Index	USD	500	-500
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	14.110	-14.110
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	ICE Bank of America Merrill Lynch Global High Yield BB-B Index	USD	407	-407
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	Russell 1000 Value Index	USD	134	-134
FTGF ClearBridge Value Fund	Russell 1000 Value Index	USD	49.285	-49.285
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	S&P 500 Index	USD	7.716	-7.716
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	59.710	-59.710
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Russell 3000 Growth Index	USD	8.695	-8.695
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones U.S. Select Dividend Index (Total)	USD	1.728	-1.728
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	Russell 3000 Index	USD	81.564	-81.564
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	681	-681
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	OECD G7 CPI + 5.5%. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	EUR	-166.313	166.313
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	OECD G7 CPI + 5.5%. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	USD	-99.562	99.562
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Value Index	USD	41.755	-41.755
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	3.868	-3.868
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	MSCI AC World Index Small Cap Net Index	USD	224	-224
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net Dividends Index	USD	862	-862
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	MSCI AC Asia ex-Japan Net Dividends Index	USD	206	-206
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	9.398	-9.398
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	50% MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Equity REITS Index Net Dividends (USD)/50% MSCI AC Asia Pacific Ex Japan/UTILITIES Index Net dividends (USD)	USD	1.001	-1.001
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	MSCI Emerging Markets Net Index	USD	1.985	-1.985
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	MSCI Europe Net Index	EUR	14.681	-14.681
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^] ***	Benchmark nicht verfügbar	EUR	/	/

* Das wahrscheinlichste Ergebnis beruht auf einer um 5 % über- oder unterdurchschnittlichen Performance gegenüber der tatsächlichen Performance der Benchmark.

** Der Fonds hat keinen Index als Benchmark, daher wurde ein Ersatzindex als Indikator für die Beta-Berechnung verwendet.

*** Der Fonds hat keine 1-Jahres-Performance, daher ist das Beta für den Fonds nicht verfügbar.

Die vorstehende Sensitivitätsanalyse sollte nicht als Hinweis auf die künftige Wertentwicklung verwendet werden.

Die Marktpreisrisiko-Sensitivitätsanalyse für den FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] wurde in die Berechnung des Marktrisikos nach dem VaR-Ansatz einbezogen (Erläuterung 12.1 oben).

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko

Die in den Fonds enthaltenen finanziellen Vermögenswerte lauten teilweise auf eine andere Währung als US-Dollar, Euro oder britisches Pfund (die Leitwährungen der Fonds), sodass sich Wechselkursschwankungen erheblich auf die Bilanzen und den Gesamtertrag auswirken können.

Western Asset ist bestrebt, alle Fremdwährungen in der Leitwährung des Fondsportfolios abzusichern. Western Asset wird in der Regel nur einen kleinen Teil des Portfolios ungesichert lassen, und auch nur dann, wenn die Aussichten darauf hindeuten, dass das Währungsrisiko attraktiv ist. In anderen Portfolios werden Absicherungen immer dann vorgenommen, wenn die Gefahr besteht, dass eine Währung um mehr als die Kosten des Absicherungsgeschäfts abwertet. Western Asset kann Cross-Hedges in Nicht-Leitwährungen vornehmen, wenn dies nach den Richtlinien erlaubt ist, unter strengen Beschränkungen (in der Regel weniger als 5 % des Portfolios) und mit dem Ziel, ein Engagement im Verhältnis zur Benchmark abzubilden.

In den folgenden Tabellen ist das Nettoengagement der Fonds im Fremdwährungsrisiko zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 angegeben.

Bei den unten aufgeführten Beträgen handelt es sich überwiegend um monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, mit Ausnahme von Anlagen in nicht zinstragenden Wertpapieren, darunter Aktien, die nicht monetäre Vermögenswerte darstellen.

Die unten aufgeführten Beträge für Devisenterminkontrakte stellen die Werte dar, die im Rahmen von Währungsverträgen eingehen und beinhalten Devisensicherungsgeschäfte. Die Beträge für die sonstigen Derivate stellen die nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung zum Jahresende dar.

Zum 29. Februar 2024

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund							
US-Dollar	\$ 813.894	\$ 312.341	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -11.817	\$ 1.114.418
Gesamt	\$ 813.894	\$ 312.341	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -11.817	\$ 1.114.418
FTGF Western Asset US Core Bond Fund							
US-Dollar	\$ 145.427	\$ 41.224	\$ 3.108	\$ –	\$ 14.58	\$ -5.757	\$ 185.460
Gesamt	\$ 145.427	\$ 41.224	\$ 3.108	\$ –	\$ 14.58	\$ -5.757	\$ 185.460
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Argentischer Peso	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 2
Australischer Dollar	–	–	–	9,02	–	805	9.825
Brasilianischer Real	5.641	–	–	–	-106	910	6.445
Britisches Pfund	–	–	–	-5.632	-3	1.214	-4.421
Kanadischer Dollar	–	–	–	5,985	–	809	6.794
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-13.213	–	–	-13.213
Euro	–	–	–	-7.059	89	689	-6.281
Indische Rupie	3.562	–	–	1,88	–	103	5.545
Japanischer Yen	–	–	–	16,056	-129	1.126	17.053
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	–	23	23
Mexikanischer Peso	30.863	–	–	-7.184	-929	2.461	25.211
Norwegische Krone	–	–	–	6,224	–	-1	6.223
Schweizer Franken	–	–	–	-512	–	–	-512
US-Dollar	558.879	208.278	348	-6.557	10.967	-9.354	762.561
Gesamt	\$ 598.945	\$ 208.278	\$ 348	\$ -992	\$ 9.889	\$ -1.213	\$ 815.255
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund							
Australischer Dollar	€ –	€ –	€ –	€ -50	€ –	€ 49	€ -1
Britisches Pfund	931	188	–	-1.539	4	303	-113
Kanadischer Dollar	–	–	–	-71	–	73	2
Euro	34.050	4.851	–	7.366	-178	2.017	48.106
Japanischer Yen	–	–	–	-172	-34	221	15
Norwegische Krone	477	–	–	28	–	9	514
Polnischer Zloty	691	–	–	80	–	14	785
Schwedische Krone	–	–	–	512	–	–	512
US-Dollar	4.914	925	782	-6.153	-7	-452	9
Gesamt	€ 41.063	€ 5.964	€ 782	€ 1	€ -215	€ 2.234	€ 49.829
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 64.560	\$ –	\$ –	\$ 64.560
Brasilianischer Real	2.953	–	–	–	–	201	3.154
Britisches Pfund	11.939	9.274	–	-19.292	36	1.759	3.716
Kanadischer Dollar	–	–	–	907	–	2	909
Kolumbianischer Peso	–	–	–	–	–	78	78
Tschechische Krone	–	–	–	–	–	36	36
Euro	17.789	7.736	–	-22.922	-85	1.740	4.258
Indische Rupie	2.192	–	–	–	–	73	2.265
Indonesische Rupiah	2.541	–	–	–	–	249	2.790
Japanischer Yen	–	–	–	6.516	–	–	6.516
Mexikanischer Peso	8.270	–	–	-221	–	173	8.222
Polnischer Zloty	4.200	–	–	780	–	227	5.207
Singapur-Dollar	–	–	–	930	–	–	930
Südafrikanischer Rand	2.804	–	–	8.028	–	128	10.960
Schweizer Franken	–	–	–	59.415	–	–	59.415
Taiwan-Dollar	–	–	–	-3.143	–	–	-3.143
US-Dollar	122.540	26.735	3.664	-96.770	-47	14.945	71.067
Gesamt	\$ 175.228	\$ 43.745	\$ 3.664	\$ -1.212	\$ -96	\$ 19.611	\$ 240.940

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US High Yield Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 2
Britisches Pfund	–	–	–	16	–	–	16
Kanadischer Dollar	–	–	–	-6	–	–	-6
Euro	–	–	–	1.794	–	–	1.794
Mexikanischer Peso	–	–	–	–	–	3	3
Singapur-Dollar	–	–	–	583	–	3	586
US-Dollar	75.307	19.466	1.233	-2.374	210	641	94.483
Gesamt	\$ 75.307	\$ 19.466	\$ 1.233	\$ 13	\$ 210	\$ 649	\$ 96.878
FTGF Western Asset Global High Yield Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 4.204	\$ –	\$ 10	\$ 4.214
Britisches Pfund	1.090	486	–	2.373	–	120	4.069
Euro	2.882	242	–	2.184	–	97	5.405
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	–	20	20
Mexikanischer Peso	837	–	–	–	–	59	896
Russischer Rubel	–	–	–	–	–	69	69
Singapur-Dollar	–	–	–	1.734	–	30	1.764
Türkische Lira	–	–	–	–	–	1	1
US-Dollar	38.376	3.438	208	-10.485	8	536	32.081
Gesamt	\$ 43.185	\$ 4.166	\$ 208	\$ 10	\$ 8	\$ 942	\$ 48.519
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund							
Australischer Dollar	\$ 4.317	\$ –	\$ –	\$ 11.076	\$ –	\$ 55	\$ 15.448
Chinesischer Renminbi	47.843	–	–	22.963	–	744	71.550
Euro	–	–	–	5.850	–	238	6.088
Indische Rupie	28.976	–	–	–	–	283	29.259
Indonesische Rupiah	33.289	–	–	–	–	199	33.488
Malaysischer Ringgit	28.868	–	–	–	–	336	29.204
Neuseeland-Dollar	–	–	–	-4.262	–	–	-4.262
Philippinischer Peso	12.614	–	–	–	–	88	12.702
Singapur-Dollar	11.880	5.840	–	15.487	–	147	33.354
Südkoreanischer Won	35.101	–	–	–	-82	710	35.729
Schweizer Franken	–	–	–	16	–	–	16
Thailändischer Baht	18.911	–	–	–	–	119	19.030
US-Dollar	15.165	–	5.476	-51.278	–	-341	-30.978
Gesamt	\$ 236.964	\$ 5.840	\$ 5.476	\$ -148	\$ -82	\$ 2.578	\$ 250.628
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund							
Britisches Pfund	\$ 81.628	\$ 11.479	\$ –	\$ 179.440	\$ –	\$ 3.363	\$ 275.910
Euro	187.976	25.082	–	-157.876	121	5.743	61.046
Japanischer Yen	–	–	–	-729	-76	575	-230
Schwedische Krone	–	–	–	10.809	–	6	10.815
Schweizer Franken	–	–	–	4.740	–	–	4.740
US-Dollar	116.745	40.594	1.097	-33.712	13	1.520	126.257
Gesamt	\$ 386.349	\$ 77.155	\$ 1.097	\$ 2.672	\$ 58	\$ 11.207	\$ 478.538
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.079	\$ 14	\$ 258	\$ 1.351
Brasilianischer Real	1.365	876	–	–	–	76	2.317
Britisches Pfund	8.122	1.647	–	-12.303	9	585	-1.940
Kanadischer Dollar	2.053	–	–	72.645	–	222	74.920
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-12.954	–	–	-12.954
Euro	22.138	6.711	–	-14.211	-121	786	15.303
Indonesische Rupiah	1.578	–	–	–	–	78	1.656
Japanischer Yen	2.273	–	–	1.026	-58	374	3.615
Mexikanischer Peso	3.888	–	–	-383	–	82	3.587
Neuseeland-Dollar	–	–	–	2.448	–	-1	2.447
Norwegische Krone	1.319	–	–	–	–	24	1.343
Polnischer Zloty	1.864	–	–	190	–	36	2.090
Südafrikanischer Rand	1.754	–	–	-4	–	262	2.012
Südkoreanischer Won	1.842	–	–	-1.917	–	24	-51
Schwedische Krone	–	–	–	1.418	–	–	1.418
US-Dollar	60.499	8.746	11.886	-36.863	-21	-11.941	32.306
Gesamt	\$ 108.695	\$ 17.980	\$ 11.886	\$ 171	\$ -177	\$ -9.135	\$ 129.420

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 1.801	\$ 2.124	\$ –	\$ -4.108	\$ -3	\$ 225	\$ 39
Kanadischer Dollar	–	–	–	-5	–	–	-5
Euro	10.736	3.833	–	-10.760	-45	873	4.637
Japanischer Yen	–	–	–	-64	-13	89	12
US-Dollar	8.842	1.923	152	15.026	-66	437	26.314
Gesamt	\$ 21.379	\$ 7.880	\$ 152	\$ 89	\$ -127	\$ 1.624	\$ 30.997
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 84.415	\$ –	\$ 1.337	\$ 85.752
Brasilianischer Real	19.663	–	–	53.012	12.333	926	85.934
Britisches Pfund	–	6.042	–	21.343	390	2.019	29.794
Kanadischer Dollar	–	–	–	-1.886	–	1.724	-162
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-516	–	–	-516
Dominik. Peso	4.027	–	–	–	–	190	4.217
Ägyptisches Pfund	515	–	–	–	–	115	630
Euro	7.297	–	–	353.960	4.767	11.379	377.403
Indische Rupie	123.978	–	–	-113.314	–	19.629	30.293
Indonesische Rupiah	77.105	–	–	-84.337	–	643	-6.589
Jamaika-Dollar	961	–	–	–	–	28	989
Japanischer Yen	–	–	–	37.781	-3.684	11.954	46.051
Mexikanischer Peso	87.311	–	–	-92.528	1.838	2.921	-458
Norwegische Krone	–	–	–	4.433	–	-45	4.388
Polnischer Zloty	56.366	–	–	-67.561	–	1.084	-10.111
Singapur-Dollar	–	–	–	27.094	–	52	27.146
Südafrikanischer Rand	45.000	–	–	-25.341	–	1.928	21.587
Südkoreanischer Won	–	–	–	22.839	–	–	22.839
Schwedische Krone	–	–	–	1.001	–	–	1.001
Schweizer Franken	–	–	–	16.029	–	74	16.103
Taiwan-Dollar	–	–	–	-25.484	–	–	-25.484
US-Dollar	539.185	207.621	44.830	-208.887	44.636	-133.223	494.162
Gesamt	\$ 961.408	\$ 213.663	\$ 44.830	\$ 2.053	\$ 60.280	\$ -77.265	\$ 1.204.969
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 7.052	\$ 17	\$ 122	\$ 7.191
Brasilianischer Real	–	–	–	1.672	-30	212	1.854
Britisches Pfund	3.312	1.343	–	261.427	201	338	266.621
Kanadischer Dollar	297	–	–	16.894	–	103	17.294
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-1.868	–	–	-1.868
Euro	107	4.136	–	52.464	-84	416	57.039
Indische Rupie	1.412	–	–	–	–	41	1.453
Indonesische Rupiah	–	–	–	-29	–	29	–
Jamaika-Dollar	204	–	–	–	–	6	210
Japanischer Yen	–	–	–	112	–	–	112
Mexikanischer Peso	4.043	–	–	-1.133	-256	999	3.653
Neuseeland-Dollar	–	–	–	–	–	9	9
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	2	2
Schweizer Franken	–	–	–	3.983	–	–	3.983
Türkische Lira	–	–	–	–	–	2	2
US-Dollar	220.536	123.221	2.643	-339.476	541	7.377	14.842
Uruguayischer Peso	–	282	–	–	–	2	284
Gesamt	\$ 229.911	\$ 128.982	\$ 2.643	\$ 1.098	\$ 389	\$ 9.658	\$ 372.681
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.777	\$ –	\$ 99	\$ 1.876
Schweizer Franken	–	–	–	72	–	–	72
US-Dollar	97.008	400.914	21.501	-1.843	-140	6.768	524.208
Gesamt	\$ 97.008	\$ 400.914	\$ 21.501	\$ 6	\$ -140	\$ 6.867	\$ 526.156
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]							
US-Dollar	\$ 1.056.220	\$ 98.109	\$ 17.502	\$ –	\$ 66	\$ -22.189	\$ 1.149.708
Gesamt	\$ 1.056.220	\$ 98.109	\$ 17.502	\$ –	\$ 66	\$ -22.189	\$ 1.149.708

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 632	\$ –	\$ 14	\$ 646
Brasilianischer Real	112	–	–	–	-4	13	121
Britisches Pfund	–	–	–	-345	2	55	-288
Kanadischer Dollar	–	–	–	335	–	11	346
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-435	–	–	-435
Euro	–	–	–	-668	–	107	-561
Indische Rupie	246	–	–	–	–	7	253
Japanischer Yen	–	–	–	860	–	6	866
Mexikanischer Peso	1.314	–	–	-161	–	134	1.287
Norwegische Krone	–	–	–	181	–	–	181
Schweizer Franken	–	–	–	-57	–	–	-57
US-Dollar	13.176	2.640	133	-384	537	-65	16.037
Gesamt	\$ 14.848	\$ 2.640	\$ 133	\$ -42	\$ 535	\$ 282	\$ 18.396
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund							
Australischer Dollar	\$ 5.806	\$ –	\$ –	\$ 6.828	\$ –	\$ 52	\$ 12.686
Brasilianischer Real	10.267	–	–	-6.256	–	-102	3.909
Britisches Pfund	9.634	–	–	6.451	–	68	16.153
Kanadischer Dollar	–	–	–	-543	–	–	-543
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-2.147	–	-1	-2.148
Kolumbianischer Peso	6.454	–	–	-1.231	–	436	5.659
Dänische Krone	–	–	–	-158	–	–	-158
Euro	5.896	–	–	25.862	–	14	31.772
Ungarischer Forint	–	–	–	3.178	–	–	3.178
Indische Rupie	–	–	–	3.302	–	–	3.302
Israelischer Schekel	–	–	–	-194	–	–	-194
Japanischer Yen	–	–	–	14.083	–	–	14.083
Mexikanischer Peso	15.927	–	–	-7.378	–	350	8.899
Neuseeland-Dollar	1.994	–	–	-1.746	–	25	273
Norwegische Krone	5.664	–	–	4.887	–	164	10.715
Polnischer Zloty	–	–	–	-313	–	337	24
Singapur-Dollar	–	–	–	-236	–	–	-236
Südafrikanischer Rand	7.203	–	–	-7.080	–	18	141
Südkoreanischer Won	–	–	–	8.565	–	–	8.565
Schwedische Krone	–	–	–	-120	–	–	-120
US-Dollar	65.123	8.749	2.596	-47.245	–	-98	29.125
Gesamt	\$ 133.968	\$ 8.749	\$ 2.596	\$ -1.491	\$ –	\$ 1.263	\$ 145.085
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 27.101	\$ –	\$ –	\$ 27.101
Brasilianischer Real	5.284	–	–	977	–	48	6.309
Britisches Pfund	3.465	–	–	11.747	–	7	15.219
Chilenischer Peso	–	–	–	4.542	–	–	4.542
Kolumbianischer Peso	10.217	–	–	–	–	635	10.852
Euro	–	–	–	9.101	256	2.176	11.533
Ungarischer Forint	–	–	–	7.203	–	–	7.203
Indische Rupie	–	–	–	7.353	–	–	7.353
Japanischer Yen	–	–	–	7.155	-51	7	7.111
Mexikanischer Peso	8.787	–	–	–	–	337	9.124
Neuseeland-Dollar	3.784	–	–	-25.353	–	45	-21.524
Norwegische Krone	–	–	–	10.073	–	–	10.073
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	91	91
Südafrikanischer Rand	5.192	–	–	-5.190	–	-1	1
Südkoreanischer Won	–	–	–	7.266	–	–	7.266
Schweizer Franken	–	–	–	-22.272	–	–	-22.272
US-Dollar	75.390	26.338	8.090	-40.594	–	-2.937	66.287
Gesamt	\$ 112.119	\$ 26.338	\$ 8.090	\$ -891	\$ 205	\$ 408	\$ 146.269
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 313	\$ –	\$ –	\$ -88	\$ –	\$ 6	\$ 231
Kanadischer Dollar	–	–	–	11.183	–	–	11.183
Euro	1.711	–	–	9.172	–	25	10.908
Schwedische Krone	–	–	–	-4	–	–	-4
Schweizer Franken	–	–	–	-2	–	–	-2
US-Dollar	27.055	662	794	-20.294	1	630	8.848
Gesamt	\$ 29.079	\$ 662	\$ 794	\$ -33	\$ 1	\$ 661	\$ 31.164

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund							
Australischer Dollar	\$ 9.283	\$ –	\$ –	\$ 15.239	\$ –	\$ 83	\$ 24.605
Brasilianischer Real	8.024	–	–	–	–	99	8.123
Britisches Pfund	20.966	–	–	-18.694	–	53	2.325
Kanadischer Dollar	–	–	–	-284	–	–	-284
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-1.176	–	-1	-1.177
Kolumbianischer Peso	12.832	–	–	-2.721	–	811	10.922
Dänische Krone	–	–	–	-38	–	–	-38
Euro	9.478	–	–	7.984	–	17	17.479
Ungarischer Forint	–	–	–	6.164	–	–	6.164
Indische Rupie	–	–	–	6.160	–	–	6.160
Israelischer Schekel	–	–	–	-47	–	–	-47
Japanischer Yen	–	–	–	31.423	–	–	31.423
Mexikanischer Peso	20.859	–	–	-4.408	–	549	17.000
Neuseeland-Dollar	1.586	–	–	12.268	–	19	13.873
Norwegische Krone	9.127	–	–	10.991	–	264	20.382
Polnischer Zloty	–	–	–	-76	–	608	532
Singapur-Dollar	–	–	–	-57	–	–	-57
Südafrikanischer Rand	8.999	–	–	-9.054	–	-1	-56
Südkoreanischer Won	–	–	–	16.566	–	–	16.566
Schwedische Krone	–	–	–	-29	–	–	-29
US-Dollar	94.909	8.109	3.580	-73.116	–	28	33.510
Gesamt	\$ 196.063	\$ 8.109	\$ 3.580	\$ -2.905	\$ –	\$ 2.529	\$ 207.376
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund							
Australischer Dollar	\$ 392	\$ –	\$ –	\$ 4.273	\$ –	\$ 2	\$ 4.667
Brasilianischer Real	41.920	–	–	-3.122	–	398	39.196
Britisches Pfund	67.561	1.262	–	-34.190	–	1.055	35.688
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.243	–	15	1.258
Kolumbianischer Peso	69.119	–	–	–	–	3.618	72.737
Tschechische Krone	–	–	–	35	–	-1	34
Euro	34.988	–	–	362.742	-2.359	900	396.271
Mexikanischer Peso	66.664	–	–	–	–	1.852	68.516
Singapur-Dollar	–	–	–	56.698	–	305	57.003
Schwedische Krone	–	–	–	2.434	–	–	2.434
US-Dollar	654.466	184.172	20.461	-388.740	55	3.162	473.576
Gesamt	\$ 935.110	\$ 185.434	\$ 20.461	\$ 1.373	\$ -2.304	\$ 11.306	\$ 1.151.380
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]							
Brasilianischer Real	\$ 158	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 49	\$ 207
Kolumbianischer Peso	463	–	–	–	–	158	621
Mexikanischer Peso	322	–	–	–	–	97	419
US-Dollar	10.021	5.764	1.275	–	–	-1.904	15.156
Gesamt	\$ 10.964	\$ 5.764	\$ 1.275	\$ –	\$ –	\$ -1.600	\$ 16.403
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 72.442	\$ –	\$ –	\$ 72.442
Brasilianischer Real	8.587	–	–	–	–	83	8.670
Britisches Pfund	–	–	–	6.960	14	76	7.050
Kanadischer Dollar	–	–	–	6.895	–	–	6.895
Kolumbianischer Peso	6.974	–	–	-2.040	–	324	5.258
Tschechische Krone	3.365	–	–	-3.266	–	47	146
Euro	–	–	–	–	-167	-5	-172
Indische Rupie	–	–	–	2.194	–	–	2.194
Japanischer Yen	–	–	–	16.830	–	–	16.830
Malaysischer Ringgit	–	–	–	1.666	–	–	1.666
Mexikanischer Peso	11.901	–	–	1.837	–	252	13.990
Neuseeland-Dollar	–	–	–	3.909	–	–	3.909
Norwegische Krone	–	–	–	3.035	–	–	3.035
Singapur-Dollar	–	–	–	76	–	-1	75
Südafrikanischer Rand	5.068	–	–	-533	–	-1	4.534
Südkoreanischer Won	–	–	–	2.297	–	–	2.297
Schweizer Franken	–	–	–	-18.128	–	–	-18.128
US-Dollar	19.143	8.566	3.994	-95.207	–	3.850	-59.654
Gesamt	\$ 55.038	\$ 8.566	\$ 3.994	\$ -1.033	\$ -153	\$ 4.625	\$ 71.037

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]							
Brasilianischer Real	\$ 742	\$ –	\$ –	\$ -222	\$ –	\$ 6	\$ 526
Britisches Pfund	1.072	161	–	-1.198	–	21	56
Kolumbianischer Peso	940	–	–	–	–	50	990
Euro	1.063	198	–	-1.122	-4	11	146
Mexikanischer Peso	1.094	–	–	-157	–	26	963
US-Dollar	3.851	6.131	579	2.696	1	-110	13.148
Gesamt	\$ 8.762	\$ 6.490	\$ 579	\$ -3	\$ -3	\$ 4	\$ 15.829
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]							
US-Dollar	\$ 29.345	\$ 290	\$ 1.040	\$ –	\$ 14	\$ 1.010	\$ 31.699
Gesamt	\$ 29.345	\$ 290	\$ 1.040	\$ –	\$ 14	\$ 1.010	\$ 31.699
FTGF ClearBridge Value Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ 11.325	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 11.325
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	142	142
Euro	–	–	21.934	108.987	–	2.739	133.660
Japanischer Yen	–	–	16.302	–	–	–	16.302
Singapur-Dollar	–	–	–	1.530	–	-42	1.488
US-Dollar	–	–	1.092.574	-109.901	–	12.036	994.709
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 1.142.135	\$ 616	\$ –	\$ 14.875	\$ 1.157.626
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 11	\$ 11
US-Dollar	–	–	210.196	–	–	1.249	211.445
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 210.196	\$ –	\$ –	\$ 1.260	\$ 211.456
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 30.014	\$ –	\$ –	\$ 30.014
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	74	74
Euro	–	–	–	88.973	–	-452	88.521
US-Dollar	–	–	1.827.864	-118.907	–	45.034	1.753.991
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 1.827.864	\$ 80	\$ –	\$ 44.656	\$ 1.872.600
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3.728	\$ –	\$ –	\$ 3.728
Britisches Pfund	–	–	–	238	–	79	317
Chinesischer Renminbi	–	–	–	825	–	–	825
Euro	–	–	–	944	–	-80	864
Singapur-Dollar	–	–	–	5.074	–	1	5.075
Schwedische Krone	–	–	–	28	–	–	28
Schweizer Franken	–	–	–	60	–	–	60
US-Dollar	–	–	205.138	-10.912	–	2.267	196.493
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 205.138	\$ -15	\$ –	\$ 2.267	\$ 207.390
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 737	\$ –	\$ –	\$ 737
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	8	8
Chinesischer Renminbi	–	–	–	64	–	–	64
Euro	–	–	–	562	–	–	562
Singapur-Dollar	–	–	–	221	–	3	224
US-Dollar	–	–	35.857	-1.584	–	68	34.341
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 35.857	\$ –	\$ –	\$ 79	\$ 35.936
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 61.711	\$ –	\$ 4.673	\$ 66.384
Euro	–	–	–	30.055	–	-31	30.024
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	58	58
US-Dollar	–	–	1.367.716	-91.412	–	-7.260	1.269.044
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 1.367.716	\$ 354	\$ –	\$ -2.560	\$ 1.365.510

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)			
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]										
Australischer Dollar	\$	–	\$	172	\$	–	\$	172		
Britisches Pfund	–	–	–	560	–	–	–	560		
Kanadischer Dollar	–	–	–	432	–	–	–	432		
Dänische Krone	–	–	–	326	–	–	–	326		
Euro	–	–	–	1.466	–	–	1	1.467		
Hongkong-Dollar	–	–	–	103	–	–	–	103		
Japanischer Yen	–	–	–	869	–	–	–	869		
Mexikanischer Peso	–	–	–	87	–	–	–	87		
Schwedische Krone	–	–	–	99	–	–	–	99		
Schweizer Franken	–	–	–	298	–	–	-1	297		
Taiwan-Dollar	–	–	–	350	–	–	–	350		
US-Dollar	–	–	–	11.821	–	–	135	11.956		
Gesamt	\$	–	\$	16.583	\$	–	\$	135	\$	16.718
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]										
Australischer Dollar	€	–	€	16.869	€	1.203	€	21	€	18.093
Brasilianischer Real	–	–	–	39.221	–	-1.674	–	–	–	37.547
Britisches Pfund	–	–	–	69.202	–	-593	–	88	–	68.697
Kanadischer Dollar	–	–	–	40.271	–	38.984	–	–	–	79.255
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	26.132	–	252	–	26.384
Dänische Krone	–	–	–	21.005	–	-1.458	–	25	–	19.572
Euro	–	–	–	214.118	–	-112.475	–	13.902	–	115.545
Japanischer Yen	–	–	–	33.247	–	-2.431	–	1	–	30.817
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	4.614	–	4	–	4.618
US-Dollar	–	–	–	373.984	–	46.833	–	1.578	–	422.395
Gesamt	€	–	€	807.917	€	-865	€	15.871	€	822.923
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund										
Australischer Dollar	\$	–	\$	14.465	\$	5.632	\$	193	\$	20.290
Brasilianischer Real	–	–	–	17.561	–	–	–	1	–	17.562
Britisches Pfund	–	–	–	33.544	–	5.327	–	174	–	39.045
Kanadischer Dollar	–	–	–	22.721	–	–	–	172	–	22.893
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	1.467	–	–	–	1.467
Euro	–	–	–	76.058	–	35.603	–	1.042	–	112.703
Hongkong-Dollar	–	–	–	5.665	–	–	–	–	–	5.665
Japanischer Yen	–	–	–	11.597	–	–	–	–	–	11.597
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	49.688	–	323	–	50.011
US-Dollar	–	–	–	144.624	–	-97.586	–	3.538	–	50.576
Gesamt	\$	–	\$	326.235	\$	131	\$	5.443	\$	331.809
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^]										
Britisches Pfund	\$	–	\$	693	\$	12	\$	2	\$	707
Kanadischer Dollar	–	–	–	61	–	–	–	–	–	61
Euro	–	–	–	1.331	–	11	–	1	–	1.343
Hongkong-Dollar	–	–	–	102	–	–	–	–	–	102
Indonesische Rupiah	–	–	–	110	–	–	–	–	–	110
Japanischer Yen	–	–	–	297	–	–	–	–	–	297
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	11	–	–	–	11
US-Dollar	–	–	–	2.550	–	-34	–	494	–	3.010
Gesamt	\$	–	\$	5.144	\$	–	\$	497	\$	5.641
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund										
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	5.403	\$	30	\$	5.433
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	5.477	–	–	–	5.477
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	144	–	131	–	275
Kanadischer Dollar	–	–	–	9.299	–	–	–	17	–	9.316
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	3.256	–	-135	–	3.121
Euro	–	–	–	–	–	38.395	–	-3.186	–	35.209
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	8.027	–	–	–	8.027
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	37.126	–	27	–	37.153
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	64	–	–	–	64
US-Dollar	–	–	–	679.843	–	-97.770	–	8.742	–	590.815
Gesamt	\$	–	\$	689.142	\$	122	\$	5.626	\$	694.890

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)	
FTGF Royce US Smaller Companies Fund								
Kanadischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	–	\$ 1.622	
Euro	–	–	–	188	–	-21	167	
Schwedische Krone	–	–	–	3	–	–	3	
US-Dollar	–	–	94.460	-190	–	-127	94.143	
Gesamt	\$	–	\$	96.082	\$	1	\$ -148	\$ 95.935
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^A								
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	–	\$ 2	\$ 157
Brasilianischer Real	–	–	–	74	–	-2	72	
Britisches Pfund	–	–	–	677	–	–	677	
Euro	–	–	–	261	–	–	261	
Japanischer Yen	–	–	–	492	–	–	493	
Polnischer Zloty	–	–	–	55	–	–	55	
Südkoreanischer Won	–	–	–	77	–	–	79	
Schwedische Krone	–	–	–	58	–	–	59	
Schweizer Franken	–	–	–	73	–	–	73	
US-Dollar	–	–	–	2.500	–	–	2.460	
Gesamt	\$	–	\$	4.422	\$	–	\$ -36	\$ 4.386
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^A								
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	–	\$ 3.424	\$ 3.424
Britisches Pfund	–	–	–	2.611	3.071	–	1	5.683
Dänische Krone	–	–	–	3.512	–	–	35	3.547
Euro	–	–	–	41.818	75.599	–	-8	117.409
Schwedische Krone	–	–	–	10.852	–	–	–	10.852
US-Dollar	–	–	–	61.696	-78.307	–	-283	-16.894
Gesamt	\$	–	\$	123.913	\$	363	\$ -255	\$ 124.021
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund								
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	–	\$ 157	\$ 7.388
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	1	–	–	1
Hongkong-Dollar	–	–	–	5.894	–	–	–	5.894
Indische Rupie	–	–	–	2.349	–	–	-78	2.271
Malaysischer Ringgit	–	–	–	605	–	–	–	605
Neuseeland-Dollar	–	–	–	1.943	–	–	6	1.949
Philippinischer Peso	–	–	–	360	–	–	–	360
Singapur-Dollar	–	–	–	2.008	228	–	20	2.256
Thailändischer Baht	–	–	–	555	–	–	15	570
US-Dollar	–	–	–	142	-250	–	-42	-150
Gesamt	\$	–	\$	21.066	\$	–	\$ 78	\$ 21.144
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^A								
Brasilianischer Real	\$	–	\$	–	\$	–	\$ 7	\$ 1.802
Britisches Pfund	–	–	–	797	–	–	–	797
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.189	–	–	-75	1.114
Hongkong-Dollar	–	–	–	5.274	–	–	–	5.274
Indische Rupie	–	–	–	6.525	–	–	-105	6.420
Indonesische Rupiah	–	–	–	1.447	–	–	–	1.447
Mexikanischer Peso	–	–	–	1.512	–	–	–	1.512
Philippinischer Peso	–	–	–	99	–	–	–	99
Saudi-Rial	–	–	–	909	–	–	1	910
Südafrikanischer Rand	–	–	–	389	–	–	–	389
Südkoreanischer Won	–	–	–	5.186	–	–	17	5.203
Taiwan-Dollar	–	–	–	4.037	–	–	–	4.037
US-Dollar	–	–	–	2.667	–	–	-24	2.643
Gesamt	\$	–	\$	31.826	\$	–	\$ -179	\$ 31.647

^A In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in fest- verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkon- trakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/- verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoin- ventarwert (in Tsd.)							
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]														
Brasilianischer Real	€	–	€	–	€	758	€	–	€	-1	€	757		
Britisches Pfund	–	–	–	7.877	–	–	–	–	–	–	–	7.877		
Dänische Krone	–	–	–	7.211	–	–	–	–	–	59	–	7.270		
Euro	–	–	–	119.483	-825	–	–	–	–	2.015	–	120.673		
Schwedische Krone	–	–	–	25.324	–	–	–	–	–	–	–	25.324		
Schweizer Franken	–	–	–	8.516	–	–	–	–	–	–	–	8.516		
US-Dollar	–	–	–	18.400	61	–	–	–	–	–	–	18.461		
Gesamt	€	–	€	–	€	186.811	€	-6	€	–	€	2.073	€	188.878
FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]														
Britisches Pfund	\$	–	\$	–	\$	821	\$	1.355	\$	–	\$	–	\$	2.176
Dänische Krone	–	–	–	359	–	–	–	–	–	1	–	360		
Euro	–	–	–	557	96	–	–	–	–	–	–	653		
Indonesische Rupiah	–	–	–	197	–	–	–	–	–	-1	–	196		
Japanischer Yen	–	–	–	71	–	–	–	–	–	–	–	71		
Schwedische Krone	–	–	–	95	–	–	–	–	–	–	–	95		
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	–	–	–	111	–	–	–	–	–	–	–	111		
US-Dollar	–	–	–	3.913	-1.446	–	–	–	–	57	–	2.524		
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	6.124	\$	5	\$	–	\$	57	\$	6.186
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]														
Euro	€	63.934	€	21.590	€	–	€	–	€	–	€	2.180	€	87.704
Gesamt	€	63.934	€	21.590	€	–	€	–	€	–	€	2.180	€	87.704

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023

Währung	Anlagen in festverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund							
US-Dollar	\$ 526.575	\$ 317.621	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -10.581	\$ 833.615
Gesamt	\$ 526.575	\$ 317.621	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -10.581	\$ 833.615
FTGF Western Asset US Core Bond Fund							
US-Dollar	\$ 103.546	\$ 34.879	\$ 1.741	\$ –	\$ 2.605	\$ -10.852	\$ 131.919
Gesamt	\$ 103.546	\$ 34.879	\$ 1.741	\$ –	\$ 2.605	\$ -10.852	\$ 131.919
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Argentinischer Peso	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 5	\$ 5
Australischer Dollar	–	–	–	14.558	-473	1.694	15.779
Brasilianischer Real	6.186	–	–	–	–	424	6.610
Britisches Pfund	–	–	–	-1.838	-96	2.607	673
Kanadischer Dollar	–	–	–	22.434	–	805	23.239
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-17.733	–	–	-17.733
Euro	–	–	–	29.230	-521	3.090	31.799
Indische Rupie	–	–	–	1.883	–	–	1.883
Indonesische Rupiah	10.217	–	–	-2.574	–	1.225	8.868
Japanischer Yen	–	–	–	5.593	186	1.338	7.117
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	–	25	25
Mexikanischer Peso	38.173	–	–	-967	-1.287	3.348	39.267
Norwegische Krone	–	–	–	6.373	–	1	6.374
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	11	11
Russischer Rubel	921	–	–	–	–	–	921
Südafrikanischer Rand	–	–	–	1.597	–	–	1.597
US-Dollar	846.500	281.132	–	-60.594	7.390	-52.163	1.022.265
Gesamt	\$ 901.997	\$ 281.132	\$ –	\$ -2.038	\$ 5.199	\$ -37.590	\$ 1.148.700
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund							
Australischer Dollar	€ –	€ –	€ –	€ -224	€ –	€ 140	€ -84
Britisches Pfund	1.785	456	–	-2.816	-12	437	-150
Kanadischer Dollar	–	–	–	-429	–	238	-191
Euro	95.827	12.812	–	15.751	-681	6.004	129.713
Japanischer Yen	–	–	–	-372	120	256	4
Norwegische Krone	–	–	–	1.691	–	–	1.691
Polnischer Zloty	1.687	–	–	-1.637	–	83	133
Schwedische Krone	–	–	–	1.397	–	–	1.397
US-Dollar	12.088	529	654	-13.627	-16	326	-46
Gesamt	€ 111.387	€ 13.797	€ 654	€ -266	€ -589	€ 7.484	€ 132.467
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 61.881	\$ –	\$ –	\$ 61.881
Brasilianischer Real	2.045	–	–	–	–	552	2.597
Britisches Pfund	10.807	7.532	–	-16.789	–	580	2.130
Kanadischer Dollar	–	–	–	902	–	2	904
Kolumbianischer Peso	–	–	–	–	–	63	63
Tschechische Krone	–	–	–	–	–	38	38
Euro	12.558	8.121	1.117	-22.728	52	5.967	5.087
Indische Rupie	–	–	–	-1.629	–	–	-1.629
Indonesische Rupiah	6.727	–	–	-1.410	–	343	5.660
Japanischer Yen	–	–	–	4.951	–	–	4.951
Mexikanischer Peso	7.562	–	–	-1.933	–	156	5.785
Polnischer Zloty	3.319	–	–	-523	–	117	2.913
Russischer Rubel	412	–	–	–	–	–	412
Singapur-Dollar	–	–	–	957	–	1	958
Südafrikanischer Rand	2.497	–	–	617	–	643	3.757
Schweizer Franken	–	–	–	54.581	–	–	54.581
Taiwan-Dollar	–	–	–	-3.258	–	–	-3.258
US-Dollar	101.955	34.926	3.313	-78.855	-7	19.193	80.525
Gesamt	\$ 147.882	\$ 50.579	\$ 4.430	\$ -3.236	\$ 45	\$ 27.655	\$ 227.355

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US High Yield Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 2
Britisches Pfund	–	–	–	41	–	–	41
Kanadischer Dollar	–	–	–	-6	–	–	-6
Euro	–	–	–	1.764	–	–	1.764
Mexikanischer Peso	–	–	–	–	–	3	3
Singapur-Dollar	–	–	–	379	–	–	379
US-Dollar	101.664	19.440	2.303	-2.212	-45	1.907	123.057
Gesamt	\$ 101.664	\$ 19.440	\$ 2.303	\$ -34	\$ -45	\$ 1.912	\$ 125.240
FTGF Western Asset Global High Yield Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 5.298	\$ –	\$ 3	\$ 5.301
Britisches Pfund	1.976	482	–	1.411	–	96	3.965
Euro	3.035	269	133	1.672	–	587	5.696
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	–	21	21
Mexikanischer Peso	743	–	–	–	–	14	757
Russischer Rubel	88	–	–	–	–	83	171
Singapur-Dollar	–	–	–	1.725	–	-4	1.721
Türkische Lira	–	–	–	–	–	1	1
US-Dollar	42.049	3.940	1	-10.317	38	4.087	39.798
Gesamt	\$ 47.891	\$ 4.691	\$ 134	\$ -211	\$ 38	\$ 4.888	\$ 57.431
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 20.732	\$ –	\$ 13	\$ 20.745
Chinesischer Renminbi	74.978	–	–	3.536	–	1.759	80.273
Euro	–	–	–	10.745	–	–	10.745
Hongkong-Dollar	–	956	–	–	–	33	989
Indische Rupie	33.683	–	–	–	–	458	34.141
Indonesische Rupiah	62.988	–	–	–	–	790	63.778
Malaysischer Ringgit	50.257	–	–	–	–	390	50.647
Philippinischer Peso	21.554	–	–	–	–	145	21.699
Singapur-Dollar	38.899	5.769	–	2.090	–	531	47.289
Südkoreanischer Won	76.610	–	–	–	-373	1.918	78.155
Schweizer Franken	–	–	–	287	–	–	287
Thailändischer Baht	23.532	–	–	–	–	151	23.683
US-Dollar	30.027	10.358	3.862	-38.358	–	-613	5.276
Gesamt	\$ 412.528	\$ 17.083	\$ 3.862	\$ -968	\$ -373	\$ 5.575	\$ 437.707
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 9.724	\$ –	\$ –	\$ 9.724
Britisches Pfund	89.845	8.554	–	197.072	239	-10.044	285.666
Euro	187.988	24.491	–	-111.391	4.675	-4.688	101.075
Japanischer Yen	–	–	–	-774	138	607	-29
Schwedische Krone	–	–	–	12.589	–	9	12.598
US-Dollar	176.288	27.956	17.040	-106.732	-61	445	114.936
Gesamt	\$ 454.121	\$ 61.001	\$ 17.040	\$ 488	\$ 4.991	\$ -13.671	\$ 523.970
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.421	\$ -22	\$ 165	\$ 1.564
Brasilianischer Real	1.455	749	–	–	–	42	2.246
Britisches Pfund	10.703	1.415	–	-14.679	–	455	-2.106
Kanadischer Dollar	2.388	–	–	87.135	–	220	89.743
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-13.277	–	–	-13.277
Euro	20.719	4.775	–	-8.159	-696	1.654	18.293
Indische Rupie	–	–	–	-299	–	–	-299
Indonesische Rupiah	1.740	–	–	–	–	89	1.829
Israelischer Schekel	–	–	–	–	–	71	71
Japanischer Yen	5.195	3.399	–	-6.916	144	416	2.238
Mexikanischer Peso	3.922	–	–	-248	–	82	3.756
Neuseeland-Dollar	–	–	–	5.015	–	–	5.015
Norwegische Krone	–	–	–	1.586	–	22	1.608
Polnischer Zloty	1.942	–	–	-1.856	–	68	154
Südafrikanischer Rand	2.282	–	–	–	–	147	2.429
Südkoreanischer Won	1.808	–	–	-1.944	–	79	-57
Schwedische Krone	–	–	–	1.603	–	–	1.603
US-Dollar	67.165	6.152	11.217	-50.468	-116	-2.057	31.893
Gesamt	\$ 119.319	\$ 16.490	\$ 11.217	\$ -1.086	\$ -690	\$ 1.453	\$ 146.703

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 3.796	\$ 2.542	\$ –	\$ -6.813	\$ 15	\$ 401	\$ -59
Euro	13.255	5.127	–	-14.963	112	713	4.244
Japanischer Yen	–	–	–	307	37	81	425
US-Dollar	14.771	3.715	559	21.722	-72	745	41.440
Gesamt	\$ 31.822	\$ 11.384	\$ 559	\$ 253	\$ 92	\$ 1.940	\$ 46.050
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ 15.845	\$ –	\$ –	\$ 31.792	\$ –	\$ 2.589	\$ 50.226
Brasilianischer Real	22.887	–	–	50.630	-4.264	2.460	71.713
Britisches Pfund	–	5.770	–	32.947	-157	4.294	42.854
Kanadischer Dollar	–	–	–	37.643	–	4.075	41.718
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-18.680	–	–	-18.680
Kolumbianischer Peso	–	–	–	-20.092	–	–	-20.092
Ägyptisches Pfund	689	–	–	–	–	132	821
Euro	6.524	–	2.181	745.456	-13.694	34.499	774.966
Indische Rupie	129.539	–	–	-75.670	–	5.720	59.589
Indonesische Rupiah	174.005	–	–	-93.570	–	4.402	84.837
Japanischer Yen	–	–	–	-230.491	3.317	12.502	-214.672
Malaysischer Ringgit	–	–	–	11.047	–	–	11.047
Mexikanischer Peso	114.924	–	–	-114.820	1.018	16.451	17.573
Norwegische Krone	–	–	–	9.608	–	6	9.614
Polnischer Zloty	55.983	–	–	-53.060	–	1.915	4.838
Russischer Rubel	5.439	–	–	-4.096	–	–	1.343
Singapur-Dollar	–	–	–	73.031	–	1	73.032
Südafrikanischer Rand	31.036	–	–	771	–	854	32.661
Schwedische Krone	–	–	–	1.418	–	5	1.423
Schweizer Franken	–	–	–	21.026	–	53	21.079
Taiwan-Dollar	–	–	–	-47.438	–	–	-47.438
US-Dollar	1.002.252	331.800	16.369	-379.564	59.656	103.536	1.134.049
Gesamt	\$ 1.559.123	\$ 337.570	\$ 18.550	\$ -22.112	\$ 45.876	\$ 193.494	\$ 2.132.501
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]							
Argentinischer Peso	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 1
Australischer Dollar	–	–	–	5.231	-63	170	5.338
Brasilianischer Real	–	–	–	338	–	202	540
Britisches Pfund	1.370	950	–	175.544	-74	-1.178	176.612
Kanadischer Dollar	280	–	–	18.936	–	87	19.303
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-2.600	–	–	-2.600
Euro	842	3.144	507	42.835	28	2.263	49.619
Indonesische Rupiah	3.019	–	–	-2.495	–	148	672
Japanischer Yen	–	–	–	4.418	–	1	4.419
Mexikanischer Peso	731	–	–	-4.362	-756	1.263	-3.124
Neuseeland-Dollar	–	–	–	–	–	9	9
Norwegische Krone	–	–	–	3.614	–	-1	3.613
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	2	2
Schweizer Franken	–	–	–	4.217	–	–	4.217
Türkische Lira	–	–	–	–	–	3	3
US-Dollar	173.588	81.010	2.424	-248.105	830	6.641	16.388
Gesamt	\$ 179.830	\$ 85.104	\$ 2.931	\$ -2.429	\$ -35	\$ 9.611	\$ 275.012
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 85	\$ –	\$ –	\$ 85
Euro	–	–	–	6.064	–	–	6.064
Japanischer Yen	–	–	–	41.628	–	–	41.628
Schweizer Franken	–	–	–	300	–	–	300
US-Dollar	77.126	462.713	17.212	-49.752	244	3.928	511.471
Gesamt	\$ 77.126	\$ 462.713	\$ 17.212	\$ -1.675	\$ 244	\$ 3.928	\$ 559.548
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]							
US-Dollar	\$ 1.042.661	\$ 104.522	\$ 1.154	\$ –	\$ -378	\$ -28.452	\$ 1.119.507
Gesamt	\$ 1.042.661	\$ 104.522	\$ 1.154	\$ –	\$ -378	\$ -28.452	\$ 1.119.507
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]							
Britisches Pfund	£ 30.870	£ 10.333	£ –	£ 3.366	£ -12	£ 1.385	£ 45.942
Euro	566	428	–	-1.152	15	148	5
Japanischer Yen	–	–	–	-151	19	120	-12
US-Dollar	544	1.180	–	-2.043	-6	302	-23
Gesamt	£ 31.980	£ 11.941	£ –	£ 20	£ 16	£ 1.955	£ 45.912

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 276	\$ –	\$ –	\$ 276
Britisches Pfund	28	–	–	77.897	–	329	78.254
Euro	50	–	–	442	–	203	695
Japanischer Yen	–	–	–	477	–	–	477
Mexikanischer Peso	620	–	–	180	–	164	964
US-Dollar	65.420	27.821	253	-79.641	-173	429	14.109
Gesamt	\$ 66.118	\$ 27.821	\$ 253	\$ -369	\$ -173	\$ 1.125	\$ 94.775
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 520	\$ -16	\$ 43	\$ 547
Brasilianischer Real	91	–	–	–	–	7	98
Britisches Pfund	–	–	–	-38	-1	60	21
Kanadischer Dollar	–	–	–	742	–	11	753
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-662	–	–	-662
Euro	–	–	–	-345	3	73	-269
Indonesische Rupiah	249	–	–	29	–	32	310
Japanischer Yen	–	–	–	69	–	6	75
Mexikanischer Peso	1.214	–	–	-239	–	80	1.055
Norwegische Krone	–	–	–	185	–	–	185
Russischer Rubel	22	–	–	–	–	–	22
US-Dollar	11.478	2.884	1.342	-308	928	-18	16.306
Gesamt	\$ 13.054	\$ 2.884	\$ 1.342	\$ -47	\$ 914	\$ 294	\$ 18.441
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.532	\$ –	\$ –	\$ 2.532
Britisches Pfund	210	212	–	-400	-1	4	25
Euro	2.461	1.346	–	-4.176	59	348	38
US-Dollar	3.145	1.167	30	2.029	-4	33	6.400
Gesamt	\$ 5.816	\$ 2.725	\$ 30	\$ -15	\$ 54	\$ 385	\$ 8.995
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 186	\$ –	\$ –	\$ 186
Brasilianischer Real	9.738	–	–	-6.113	–	-55	3.570
Britisches Pfund	7.053	–	–	16.986	–	121	24.160
Kanadischer Dollar	4.585	–	–	-1.219	–	28	3.394
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-950	–	–	-950
Kolumbianischer Peso	7.920	–	–	-2.571	–	456	5.805
Dänische Krone	–	–	–	-189	–	–	-189
Euro	8.814	–	–	36.527	–	249	45.590
Israelischer Schekel	–	–	–	-194	–	–	-194
Japanischer Yen	–	–	–	25.308	–	–	25.308
Mexikanischer Peso	24.449	–	–	-21.477	–	468	3.440
Neuseeland-Dollar	2.062	–	–	-1.953	–	26	135
Norwegische Krone	6.120	–	–	-115	–	94	6.099
Polnischer Zloty	7.036	–	–	-1.454	–	456	6.038
Russischer Rubel	6.292	–	–	–	–	55	6.347
Singapur-Dollar	–	–	–	-271	–	–	-271
Südafrikanischer Rand	9.422	–	–	-9.386	–	20	56
Südkoreanischer Won	8.781	–	–	-4.666	–	52	4.167
Schwedische Krone	–	–	–	-118	–	–	-118
Thailändischer Baht	–	–	–	1.431	–	–	1.431
US-Dollar	47.246	10.717	4.095	-30.596	–	-3.457	28.005
Gesamt	\$ 149.518	\$ 10.717	\$ 4.095	\$ -834	\$ –	\$ -1.487	\$ 162.009
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 149.903	\$ –	\$ –	\$ 149.903
Brasilianischer Real	39.348	–	–	-13.194	–	644	26.798
Britisches Pfund	–	–	–	12.300	–	1.647	13.947
Kanadischer Dollar	–	–	–	16.353	–	–	16.353
Kolumbianischer Peso	31.019	–	–	20.996	–	1.747	53.762
Euro	–	4.018	–	154.722	–	-1.776	156.964
Japanischer Yen	–	–	–	–	2.086	-11	2.075
Mexikanischer Peso	31.005	–	–	-32.918	–	1.169	-744
Neuseeland-Dollar	14.430	–	–	-3.487	–	166	11.109
Norwegische Krone	–	–	–	48.046	–	1	48.047
Peruanischer Nuevo Sol	19.905	–	–	-20.189	–	66	-218
Polnischer Zloty	23.077	–	–	-23.648	–	585	14
Südafrikanischer Rand	15.712	–	–	-15.997	–	-2	-287
Schweizer Franken	–	–	–	-64.929	–	–	-64.929
US-Dollar	245.418	84.210	30.565	-238.561	104	4.741	126.477
Gesamt	\$ 419.914	\$ 88.228	\$ 30.565	\$ -10.603	\$ 2.190	\$ 8.977	\$ 539.271

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 67	\$ -	\$ -	\$ 67
Kanadischer Dollar	-	-	-	9.884	-	-	9.884
Euro	79	-	-	-7	-	-	72
Schwedische Krone	-	-	-	-2	-	-	-2
Schweizer Franken	-	-	-	-2	-	-	-2
US-Dollar	9.551	334	396	-10.132	2	224	375
Gesamt	\$ 9.630	\$ 334	\$ 396	\$ -192	\$ 2	\$ 224	\$ 10.394
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund							
Australischer Dollar	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -255	\$ -	\$ -	\$ -255
Brasilianischer Real	11.157	-	-	-5.044	-	174	6.287
Britisches Pfund	1.556	-	-	9.178	-	6	10.740
Kanadischer Dollar	1.527	-	-	4.328	-	26	5.881
Chinesischer Renminbi	-	-	-	-688	-	-	-688
Kolumbianischer Peso	12.040	-	-	-3.628	-	726	9.138
Dänische Krone	-	-	-	-51	-	-	-51
Euro	11.990	40	-	21.821	-	142	33.993
Israelischer Schekel	-	-	-	-52	-	-	-52
Japanischer Yen	-	-	-	41.040	-	-	41.040
Malaysischer Ringgit	5.778	-	-	-5.221	-	83	640
Mexikanischer Peso	25.446	-	-	-19.832	-	624	6.238
Neuseeland-Dollar	1.673	-	-	13.940	-	20	15.633
Norwegische Krone	1.518	-	-	8.288	-	24	9.830
Polnischer Zloty	8.284	-	-	890	-	727	9.901
Russischer Rubel	55	-	-	-	-	-	55
Singapur-Dollar	-	-	-	-73	-	-	-73
Südafrikanischer Rand	7.572	-	-	-7.184	-	-2	386
Südkoreanischer Won	13.957	-	-	-7.291	-	82	6.748
Schwedische Krone	-	-	-	-32	-	-	-32
Thailändischer Baht	-	-	-	2.331	-	1	2.332
US-Dollar	71.025	27.021	4.087	-55.256	-	578	47.455
Gesamt	\$ 173.578	\$ 27.061	\$ 4.087	\$ -2.791	\$ -	\$ 3.211	\$ 205.146
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund							
Australischer Dollar	\$ 388	\$ -	\$ -	\$ 4.727	\$ -	\$ 2	\$ 5.117
Brasilianischer Real	44.532	-	-	-625	-	719	44.626
Britisches Pfund	-	1.173	-	46.639	-	89	47.901
Chinesischer Renminbi	-	-	-	868	-	-	868
Kolumbianischer Peso	35.719	-	-	-	-	2.820	38.539
Tschechische Krone	-	-	-	29	-	-	29
Euro	22.650	-	-	408.937	-878	532	431.241
Japanischer Yen	-	-	-	-	-2.581	136	-2.445
Mexikanischer Peso	38.254	-	-	-2.826	-	1.585	37.013
Singapur-Dollar	-	-	-	61.210	-	88	61.298
Schwedische Krone	-	-	-	2.020	-	-	2.020
Schweizer Franken	-	-	-	483	-	-	483
US-Dollar	741.247	184.488	85.354	-530.341	186	62.681	543.615
Gesamt	\$ 882.790	\$ 185.661	\$ 85.354	\$ -8.879	\$ -3.273	\$ 68.652	\$ 1.210.305
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]							
Brasilianischer Real	\$ 890	\$ -	\$ -	\$ -890	\$ -	\$ 15	\$ 15
Britisches Pfund	-	-	-	-1.169	-	-	-1.169
Kolumbianischer Peso	802	-	-	-889	-	31	-56
Euro	-	2.802	-	-3.578	17	15	-744
Japanischer Yen	-	-	-	-	-74	4	-70
US-Dollar	12.080	26.981	2.238	6.550	-86	1.017	48.780
Gesamt	\$ 13.772	\$ 29.783	\$ 2.238	\$ 24	\$ -143	\$ 1.082	\$ 46.756
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -9	\$ -	\$ -	\$ -9
Kanadischer Dollar	-	-	-	-64	-	-	-64
Euro	97	-	-	8.360	-	1	8.458
US-Dollar	7.778	202	411	-8.479	-	92	4
Gesamt	\$ 7.875	\$ 202	\$ 411	\$ -192	\$ -	\$ 93	\$ 8.389

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 71.448	\$ –	\$ –	\$ 71.448
Brasilianischer Real	7.638	–	–	–	–	119	7.757
Britisches Pfund	–	–	–	7.018	–	–	7.018
Kanadischer Dollar	–	–	–	7.370	–	–	7.370
Chilenischer Peso	–	–	–	6.716	–	1	6.717
Kolumbianischer Peso	5.023	–	–	-1.784	–	295	3.534
Tschechische Krone	3.362	–	–	-3.361	–	53	54
Euro	–	–	–	–	-283	-1	-284
Japanischer Yen	–	–	–	14.477	–	–	14.477
Malaysischer Ringgit	1.810	–	–	134	–	26	1.970
Mexikanischer Peso	13.934	–	–	–	–	287	14.221
Neuseeland-Dollar	–	–	–	4.260	–	–	4.260
Norwegische Krone	–	–	–	3.326	–	–	3.326
Singapur-Dollar	–	–	–	73	–	–	73
Südafrikanischer Rand	5.953	–	–	-557	–	-2	5.394
Südkoreanischer Won	4.525	–	–	-2.231	–	26	2.320
Thailändischer Baht	–	–	–	2.413	–	–	2.413
US-Dollar	11.900	11.663	3.886	-112.535	–	2.428	-82.658
Gesamt	\$ 54.145	\$ 11.663	\$ 3.886	\$ -3.233	\$ -283	\$ 3.232	\$ 69.410
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]							
Brasilianischer Real	\$ 695	\$ –	\$ –	\$ -184	\$ –	\$ 9	\$ 520
Britisches Pfund	160	–	–	-108	–	2	54
Kolumbianischer Peso	437	–	–	–	–	34	471
Euro	541	184	–	-619	-62	8	52
Japanischer Yen	–	–	–	–	-47	2	-45
Mexikanischer Peso	612	–	–	-178	–	20	454
US-Dollar	7.741	2.760	–	1.111	19	1.667	13.298
Gesamt	\$ 10.186	\$ 2.944	\$ –	\$ 22	\$ -90	\$ 1.742	\$ 14.804
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.338	\$ –	\$ –	\$ 1.338
US-Dollar	–	–	2.583	-1.358	–	-29	1.196
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 2.583	\$ -20	\$ –	\$ -29	\$ 2.534
FTGF ClearBridge Value Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ 7.710	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 7.710
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	230	230
Euro	–	–	34.655	61.883	–	-580	95.958
Japanischer Yen	–	–	10.195	–	–	–	10.195
Singapur-Dollar	–	–	–	1.757	–	-21	1.736
US-Dollar	–	–	869.426	-64.606	–	9.077	813.897
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 921.986	\$ -966	\$ –	\$ 8.706	\$ 929.726
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 42	\$ 42
US-Dollar	–	–	180.681	–	–	8.887	189.568
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 180.681	\$ –	\$ –	\$ 8.929	\$ 189.610
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 22.751	\$ –	\$ 477	\$ 23.228
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	-55	-55
Euro	–	–	–	29.795	–	51	29.846
US-Dollar	–	–	1.172.787	-53.811	–	53.740	1.172.716
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 1.172.787	\$ -1.265	\$ –	\$ 54.213	\$ 1.225.735
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 4.676	\$ –	\$ -1	\$ 4.675
Britisches Pfund	–	–	–	348	–	170	518
Chinesischer Renminbi	–	–	–	980	–	–	980
Euro	–	–	–	738	–	1	739
Singapur-Dollar	–	–	–	1.365	–	–	1.365
Schwedische Krone	–	–	–	18	–	–	18
Schweizer Franken	–	–	–	48	–	–	48
US-Dollar	–	–	214.039	-8.398	–	10.809	216.450
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 214.039	\$ -225	\$ –	\$ 10.979	\$ 224.793

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 864	\$ –	\$ –	\$ 864
Kanadischer Dollar	–	–	114	–	–	-105	9
Chinesischer Renminbi	–	–	–	60	–	–	60
Euro	–	–	–	851	–	–	851
Singapur-Dollar	–	–	–	602	–	–	602
US-Dollar	557	–	35.919	-2.432	–	2.098	36.142
Gesamt	\$ 557	\$ –	\$ 36.033	\$ -55	\$ –	\$ 1.993	\$ 38.528
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 75.460	\$ –	\$ 546	\$ 76.006
Kanadischer Dollar	–	–	21.126	–	–	-21.126	–
Euro	–	–	–	31.670	–	-1.111	30.559
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	78	78
US-Dollar	–	–	1.607.907	-107.948	–	33.377	1.533.336
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 1.629.033	\$ -818	\$ –	\$ 11.764	\$ 1.639.979
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 265	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 266
Britisches Pfund	–	–	507	–	–	–	507
Kanadischer Dollar	–	–	457	–	–	–	457
Euro	–	–	1.355	–	–	-1	1.354
Hongkong-Dollar	–	–	727	–	–	–	727
Japanischer Yen	–	–	722	–	–	–	722
Schwedische Krone	–	–	135	–	–	–	135
Schweizer Franken	–	–	477	–	–	–	477
US-Dollar	–	–	8.178	–	–	356	8.534
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 12.823	\$ –	\$ –	\$ 356	\$ 13.179
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]							
Australischer Dollar	€ –	€ –	€ 53.833	€ -1.557	€ –	€ 63	€ 52.339
Brasilianischer Real	–	–	18.045	1.357	–	–	19.402
Britisches Pfund	–	–	115.566	5.910	–	848	122.324
Kanadischer Dollar	–	–	93.188	39.871	–	93	133.152
Chinesischer Renminbi	–	–	–	23.823	–	-73	23.750
Dänische Krone	–	–	–	–	–	40	40
Euro	–	–	266.281	-148.999	–	26.462	143.744
Japanischer Yen	–	–	63.941	-4.896	–	–	59.045
Singapur-Dollar	–	–	–	4.319	–	-25	4.294
US-Dollar	–	–	421.656	81.035	–	2.052	504.743
Gesamt	€ –	€ –	€ 1.032.510	€ 863	€ –	€ 29.460	€ 1.062.833
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 40.244	\$ 8.200	\$ –	\$ 846	\$ 49.290
Brasilianischer Real	–	–	21.614	–	–	21	21.635
Britisches Pfund	–	–	57.318	5.860	–	593	63.771
Kanadischer Dollar	–	–	49.509	–	–	-5.967	43.542
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.376	–	–	1.376
Euro	–	–	88.419	45.189	–	775	134.383
Hongkong-Dollar	–	–	4.748	–	–	–	4.748
Japanischer Yen	–	–	14.256	–	–	–	14.256
Singapur-Dollar	–	–	–	65.895	–	49	65.944
US-Dollar	–	–	123.182	-128.725	–	12.646	7.103
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 399.290	\$ -2.205	\$ –	\$ 8.963	\$ 406.048
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 5.819	\$ –	\$ -2	\$ 5.817
Brasilianischer Real	–	–	–	6.595	–	–	6.595
Britisches Pfund	–	–	–	457	–	101	558
Kanadischer Dollar	–	–	7.728	–	–	-4.628	3.100
Chinesischer Renminbi	–	–	–	2.348	–	–	2.348
Euro	–	–	–	32.066	–	-281	31.785
Polnischer Zloty	–	–	–	3.756	–	–	3.756
Singapur-Dollar	–	–	–	26.050	–	177	26.227
Schwedische Krone	–	–	–	79	–	–	79
US-Dollar	–	–	736.385	-78.643	–	3.522	661.264
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 744.113	\$ -1.473	\$ –	\$ -1.111	\$ 741.529

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund							
Kanadischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 1.206	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.206
Euro	–	–	–	98	–	10	108
Schwedische Krone	–	–	–	1	–	1	2
US-Dollar	–	–	77.448	-101	–	-565	76.782
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 78.654	\$ -2	\$ –	\$ -554	\$ 78.098
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 150	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 152
Brasilianischer Real	–	–	44	–	–	–	44
Britisches Pfund	–	–	573	–	–	-1	572
Euro	–	–	295	–	–	1	296
Japanischer Yen	–	–	496	–	–	–	496
Polnischer Zloty	–	–	57	–	–	–	57
Südkoreanischer Won	–	–	85	–	–	1	86
Schwedische Krone	–	–	46	–	–	–	46
Schweizer Franken	–	–	76	–	–	–	76
US-Dollar	–	–	2.451	–	–	-22	2.429
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 4.273	\$ –	\$ –	\$ -19	\$ 4.254
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 2.708	\$ 2.549	\$ –	\$ 12	\$ 5.269
Chinesischer Renminbi	–	–	–	174	–	-1	173
Hongkong-Dollar	–	–	7.445	–	–	–	7.445
Indische Rupie	–	–	1.478	–	–	-41	1.437
Indonesische Rupiah	–	–	1.102	–	–	–	1.102
Malaysischer Ringgit	–	–	482	–	–	–	482
Pakistan Rupie	–	–	93	–	–	–	93
Philippinischer Peso	–	–	310	–	–	–	310
Polnischer Zloty	–	–	–	36	–	–	36
Singapur-Dollar	–	–	261	32	–	–	293
Südkoreanischer Won	–	–	2.654	–	–	41	2.695
Taiwan-Dollar	–	–	3.609	–	–	–	3.609
Thailändischer Baht	–	–	293	–	–	–	293
US-Dollar	–	–	448	-2.881	–	286	-2.147
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 20.883	\$ -90	\$ –	\$ 297	\$ 21.090
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]							
Hongkong-Dollar	\$ –	\$ –	\$ 1.697	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 1.698
Indische Rupie	–	–	251	–	–	4	255
Indonesische Rupiah	–	–	67	–	–	–	67
Singapur-Dollar	–	–	562	–	–	–	562
Südkoreanischer Won	–	–	584	–	–	13	597
Taiwan-Dollar	–	–	437	–	–	–	437
US-Dollar	–	–	–	–	–	-78	-78
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 3.598	\$ –	\$ –	\$ -60	\$ 3.538
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 4.608	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 4.609
Britisches Pfund	–	–	3.291	2.614	–	18	5.923
Dänische Krone	–	–	4.935	–	–	28	4.963
Euro	–	–	43.115	87.573	–	-30	130.658
Hongkong-Dollar	–	–	8.564	–	–	–	8.564
Schwedische Krone	–	–	14.064	–	–	–	14.064
US-Dollar	–	–	63.952	-91.568	–	-116	-27.732
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 142.529	\$ -1.381	\$ –	\$ -99	\$ 141.049
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 8.456	\$ 377	\$ –	\$ 137	\$ 8.970
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1	–	–	1
Hongkong-Dollar	–	–	6.999	–	–	1	7.000
Indische Rupie	–	–	2.993	–	–	5	2.998
Malaysischer Ringgit	–	–	647	–	–	-1	646
Neuseeland-Dollar	–	–	2.015	–	–	–	2.015
Philippinischer Peso	–	–	277	–	–	–	277
Singapur-Dollar	–	–	2.768	309	–	56	3.133
Thailändischer Baht	–	–	808	–	–	14	822
US-Dollar	–	–	–	-705	–	-36	-741
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 24.963	\$ -18	\$ –	\$ 176	\$ 25.121

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinlichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)							
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]														
Brasilianischer Real	\$	–	\$	–	\$	–	\$	6	\$	2.095				
Britisches Pfund	–	–	–	751	–	–	–	–	–	751				
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.557	–	–	–	–	–	1.557				
Hongkong-Dollar	–	–	–	8.238	–	–	–	-1	–	8.237				
Indische Rupie	–	–	–	5.907	–	–	–	-43	–	5.864				
Indonesische Rupiah	–	–	–	1.229	–	–	–	–	–	1.229				
Mexikanischer Peso	–	–	–	1.587	–	–	–	–	–	1.587				
Philippinischer Peso	–	–	–	148	–	–	–	–	–	148				
Saudi-Rial	–	–	–	617	–	–	–	–	–	617				
Südkoreanischer Won	–	–	–	5.522	–	–	–	25	–	5.547				
Taiwan-Dollar	–	–	–	4.327	–	–	–	–	–	4.327				
US-Dollar	–	–	–	2.575	–	–	–	168	–	2.743				
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	155	\$	34.702		
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]														
Brasilianischer Real	€	–	€	–	€	1.333	€	–	€	–	€	1.333		
Britisches Pfund	–	–	–	9.887	–	–	–	–	–	871	–	10.758		
Dänische Krone	–	–	–	7.103	–	–	–	–	–	39	–	7.142		
Euro	–	–	–	127.442	-1.383	–	–	-760	–	–	–	125.299		
Schwedische Krone	–	–	–	25.502	–	–	–	–	–	132	–	25.634		
Schweizer Franken	–	–	–	6.353	–	–	–	–	–	34	–	6.387		
US-Dollar	–	–	–	12.493	52	–	–	–	–	-1	–	12.544		
Gesamt	€	–	€	–	€	188.780	€	2	€	–	€	315	€	189.097
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]														
Euro	€	25.460	€	9.299	€	–	€	–	€	–	€	2.064	€	36.823
Gesamt	€	25.460	€	9.299	€	–	€	–	€	–	€	2.064	€	36.823

Bestimmte Fonds haben auch Anteilsklassen, die in Fremdwährungen ausgegeben werden. Bestimmte Fonds (wie im jeweiligen Nachtrag zum Prospekt angegeben) können sowohl lieferbare als auch nicht lieferbare Devisenterminkontrakte abschließen, um sich gegen Wechselkursrisiken abzusichern, das Engagement in einer Währung zu erhöhen, das Risiko von Währungsschwankungen von einer Währung in eine andere zu verlagern oder die Rendite zu steigern. Jeder Rentenfonds kann auch Optionen auf Devisenterminkontrakte, sowohl lieferbare als auch nicht lieferbare, abschließen, die dem Fonds gegen eine Prämie die Option einräumen, aber nicht die Verpflichtung auferlegen, einen solchen Kontrakt zu einem bestimmten Zeitpunkt vor einem bestimmten Datum abzuschließen.

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Sensitivitätsanalyse in Bezug auf das Fremdwährungsrisiko und dessen Auswirkung auf den Nettoinventarwert der Fonds, sofern das Fremdwährungsrisiko als erheblich eingestuft wird. Am 29. Februar 2024 und am 28. Februar 2023 wurde für alle Fonds ein Auszug der zugrunde liegenden Positionen erstellt. Die Wechselkurse wurden um +/- 5 % erhöht/ gesenkt (aufgrund der Beschaffenheit der Märkte, in denen die Fonds anlegen, wurde eine 5 %-ige Erhöhung/Senkung vorgenommen); es wurde eine Schätzung der entsprechenden Auswirkung auf den Gesamt Nettoinventarwert vorgenommen. Des Weiteren wird angenommen, dass auch alle anderen Marktparameter unverändert bleiben.

Fonds	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Änderungen der Wechselkurse (Betrag in der Basiswährung des Fonds) (in Tsd.)			
		29. Februar 2024		28. Februar 2023	
		Positiv 5 %	Negativ 5 %	Positiv 5 %	Negativ 5 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Australischer Dollar	3.398	-3.074	3.257	-2.947
	Schweizer Franken	3.127	-2.829	2.873	-2.599
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Euro	284	-257	/	/
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Chinesischer Renminbi	3.766	-3.407	/	/
	Indische Rupie	1.540	-1.393	/	/
	Indonesische Rupiah	1.763	-1.595	3.357	-3.037
	Malaysischer Ringgit	1.537	-1.391	2.666	-2.412
	Singapur-Dollar	1.755	-1.588	2.489	-2.252
	Südkoreanischer Won	1.880	-1.701	4.113	-3.722
	Britisches Pfund	14.522	-13.139	15.035	-13.603
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Euro	3.213	-2.907	5.320	-4.813
	Kanadischer Dollar	3.943	-3.568	4.723	-4.273
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Chinesischer Renminbi	-682	617	/	/
	Euro	805	-729	963	-871
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Euro	244	-221	/	/
	Euro	19.863	-17.972	40.788	-36.903
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Japanischer Yen	/	/	-11.299	10.222
	Britisches Pfund	14.033	-12.696	9.295	-8.410
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Euro	3.002	-2.716	2.612	-2.363
	Britisches Pfund	/	/	4.119	-3.726
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Brasilianischer Real	/	/	133	-121
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Britisches Pfund	850	-769	1.272	-1.150
	Euro	1.672	-1.513	2.399	-2.171
	Japanischer Yen	/	/	1.332	-1.205
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Australischer Dollar	1.426	-1.291	7.890	-7.138
	Britisches Pfund	801	-725	/	/
	Euro	/	/	8.261	-7.474
	Neuseeland-Dollar	-1.133	1.025	/	/
	Schweizer Franken	-1.172	1.061	-3.417	3.092
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Kanadischer Dollar	589	-533	520	-471
	Euro	574	-519	/	/

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Fonds	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Änderungen der Wechselkurse (Betrag in der Basiswährung des Fonds) (in Tsd.)			
		29. Februar 2024		28. Februar 2023	
		Positiv 5 %	Negativ 5 %	Positiv 5 %	Negativ 5 %
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Australischer Dollar	1.295	-1.172	/	/
	Euro	/	/	1.789	-1.619
	Japanischer Yen	1.654	-1.496	2.160	-1.954
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Euro	20.856	-18.870	22.697	-20.535
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	Euro	/	/	445	-403
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	Australischer Dollar	3.813	-3.450	3.760	-3.402
	Brasilianischer Real	456	-413	408	-369
	Britisches Pfund	/	/	369	-334
	Kanadischer Dollar	/	/	388	-351
	Japanischer Yen	886	-801	762	-689
	Mexikanischer Peso	736	-666	748	-677
	Schweizer Franken	-954	863	/	/
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	Euro	/	/	70	-64
FTGF ClearBridge Value Fund	Euro	7.035	-6.365	5.050	-4.569
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	Euro	/	/	71	-64
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	Kanadischer Dollar	/	/	7.008	-6.341
	Britisches Pfund	/	/	6.438	-5.825
	US-Dollar	22.231	-20.114	26.565	-24.035
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Australischer Dollar	/	/	2.594	-2.347
	Britisches Pfund	2.055	-1.859	3.356	-3.037
	Kanadischer Dollar	/	/	2.292	-2.073
	Euro	5.932	-5.367	7.073	-6.399
	Singapur-Dollar	2.632	-2.381	3.471	-3.140
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Britisches Pfund	36	-32	30	-27
	Japanischer Yen	26	-23	26	-24
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Australischer Dollar	/	/	277	-251
	Hongkong-Dollar	/	/	392	-355
	Südkoreanischer Won	/	/	142	-128
	Taiwan-Dollar	/	/	190	-172
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	Hongkong-Dollar	/	/	89	-81
	Singapur-Dollar	/	/	30	-27
	Südkoreanischer Won	/	/	31	-28
	Taiwan-Dollar	/	/	23	-21
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Euro	6.179	-5.591	6.877	-6.222
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Australischer Dollar	389	-352	472	-427
	Hongkong-Dollar	310	-281	368	-333
	Indische Rupie	120	-108	158	-143
	Singapur-Dollar	119	-107	165	-149
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Hongkong-Dollar	278	-251	434	-392
	Indische Rupie	338	-306	309	-279
	Südkoreanischer Won	274	-248	292	-264
	Taiwan-Dollar	212	-192	228	-206
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	Schwedische Krone	1.333	-1.206	1.349	-1.221
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	Britisches Pfund	115	-104	/	/
	Euro	34	-31	/	/

Eine Analyse wird angegeben, sofern der Fonds ein erhebliches Fremdwährungsengagement enthält. Als erheblich gilt ein Engagement, wenn es 10 % des Nettovermögens übersteigt. Veränderungen sämtlicher Wechselkurse werden sich direkt auf den Nettoinventarwert auswirken. Die Wechselkurse zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 sind in Erläuterung 11 angegeben. Diese Sensitivitätsanalyse sollte nicht als Prognose für die künftige Wertentwicklung verwendet werden.

Die Fremdwährungsrisiko-Sensitivitätsanalyse für den FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] wurde in die Berechnung des Marktrisikos nach dem VaR-Ansatz einbezogen (Erläuterung 12.1 oben).

(c) Zinsrisiko

Eine Sensitivitätsanalyse für die Aktienfonds wurde nicht erstellt, da die Mehrheit der Vermögenswerte der Aktienfonds unverzinsliche Vermögenswerte sind und das Risiko daher nicht wesentlich genug ist.

Zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 wurden die gesamten Barmittel der Fonds bei der Verwahrstelle oder sonstigen Brokern gehalten und haben das Potenzial zur Erwirtschaftung von Zinsen, deren Höhe je nach den aktuellen Marktzinsen schwankt.

Erläuterung 12.1(b) oben enthält eine Analyse der fest und variabel verzinslichen sowie der unverzinslichen Wertpapiere.

Die gewichtete durchschnittliche Rendite und die gewichteten durchschnittlichen Laufzeiten bis zur Fälligkeit der festverzinslichen Instrumente jedes Fonds nach Währung stellten sich zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 wie folgt dar:

Zum 29. Februar 2024

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
US-Dollar	2,25 %	0,12
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
US-Dollar	4,25 %	20,01
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Brasilianischer Real	10,20 %	5,85
Indische Rupie	7,22 %	6,61
Mexikanischer Peso	8,85 %	16,59
US-Dollar	4,58 %	17,69

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Euro	1,78 %	9,12
Norwegische Krone	3,08 %	9,28
Polnischer Zloty	2,26 %	8,16
Britisches Pfund	4,90 %	4,44
US-Dollar	4,49 %	14,28
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Brasilianischer Real	10,01 %	2,84
Euro	4,61 %	4,39
Indische Rupie	6,61 %	4,54
Indonesische Rupiah	6,87 %	3,21
Mexikanischer Peso	8,85 %	12,27
Polnischer Zloty	2,26 %	8,16
Britisches Pfund	5,21 %	5,70
Südafrikanischer Rand	10,93 %	17,01
US-Dollar	4,80 %	8,91
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
US-Dollar	7,59 %	5,56
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Euro	5,09 %	3,57
Mexikanischer Peso	8,66 %	12,88
Britisches Pfund	5,67 %	2,65
US-Dollar	6,15 %	5,64
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Australischer Dollar	3,95 %	13,15
Chinesischer Renminbi	3,55 %	10,34
Indische Rupie	7,25 %	9,90
Indonesische Rupiah	7,14 %	11,51
Malaysischer Ringgit	4,20 %	9,39
Philippinischer Peso	6,66 %	11,88
Singapur-Dollar	2,78 %	14,84
Südkoreanischer Won	2,06 %	8,59
Thailändischer Baht	3,12 %	14,31
US-Dollar	4,29 %	6,08
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	1,95 %	4,44
Britisches Pfund	3,81 %	3,47
US-Dollar	3,48 %	4,10
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,32 %	6,84
Kanadischer Dollar	3,55 %	16,60
Euro	1,39 %	9,10
Indonesische Rupiah	7,31 %	15,13
Japanischer Yen	0,55 %	26,01
Mexikanischer Peso	8,96 %	18,72
Norwegische Krone	3,08 %	9,28
Polnischer Zloty	2,26 %	8,16
Britisches Pfund	4,61 %	10,46
Südafrikanischer Rand	10,93 %	17,01
Südkoreanischer Won	1,94 %	2,28
US-Dollar	3,21 %	14,32
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Euro	2,82 %	6,08
Britisches Pfund	3,77 %	5,27
US-Dollar	5,33 %	13,89
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,25 %	5,96
Dominik. Peso	10,21 %	11,55
Ägyptisches Pfund	18,61 %	0,25
Euro	5,80 %	7,92
Indische Rupie	6,85 %	6,38
Indonesische Rupiah	6,86 %	6,46
Jamaika-Dollar	9,09 %	6,68
Mexikanischer Peso	9,01 %	20,05
Polnischer Zloty	2,26 %	8,16
Südafrikanischer Rand	9,89 %	13,01
US-Dollar	5,81 %	18,14

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Kanadischer Dollar	5,48 %	2,21
Euro	5,88 %	2,77
Indische Rupie	7,22 %	6,61
Jamaika-Dollar	9,09 %	6,68
Mexikanischer Peso	8,28 %	4,68
Britisches Pfund	5,92 %	3,00
US-Dollar	7,13 %	7,27
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
US-Dollar	6,73 %	13,86
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
US-Dollar	4,71 %	25,85
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,39 %	8,85
Indische Rupie	7,22 %	6,61
Mexikanischer Peso	8,96 %	18,72
US-Dollar	4,55 %	16,82
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Australischer Dollar	2,76 %	0,14
Brasilianischer Real	9,87 %	1,86
Kolumbianischer Peso	10,34 %	18,25
Euro	0,00 %	0,13
Mexikanischer Peso	8,71 %	15,36
Neuseeland-Dollar	4,32 %	15,40
Norwegische Krone	3,00 %	0,04
Britisches Pfund	2,55 %	27,44
Südafrikanischer Rand	10,02 %	15,10
US-Dollar	3,84 %	13,68
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,39 %	8,85
Kolumbianischer Peso	10,26 %	23,52
Mexikanischer Peso	9,21 %	27,80
Neuseeland-Dollar	4,08 %	27,22
Britisches Pfund	2,55 %	27,44
Südafrikanischer Rand	12,11 %	24,01
US-Dollar	4,42 %	17,95
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Euro	6,11 %	4,63
Britisches Pfund	2,77 %	0,29
US-Dollar	6,90 %	4,03
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Australischer Dollar	2,76 %	0,14
Brasilianischer Real	10,17 %	5,13
Kolumbianischer Peso	9,74 %	16,19
Euro	0,00 %	0,13
Mexikanischer Peso	9,07 %	20,77
Neuseeland-Dollar	4,08 %	27,22
Norwegische Krone	3,00 %	0,04
Britisches Pfund	3,04 %	17,49
Südafrikanischer Rand	11,67 %	21,39
US-Dollar	4,41 %	19,05
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Australischer Dollar	2,66 %	6,80
Brasilianischer Real	9,69 %	3,31
Kolumbianischer Peso	8,71 %	13,31
Euro	2,84 %	28,69
Mexikanischer Peso	8,48 %	15,98
Britisches Pfund	4,31 %	29,67
US-Dollar	5,52 %	4,17
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Brasilianischer Real	7,89 %	4,84
Kolumbianischer Peso	7,46 %	21,22
Mexikanischer Peso	6,52 %	9,24
US-Dollar	5,91 %	3,92
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,23 %	5,71
Kolumbianischer Peso	7,70 %	6,82
Tschechische Krone	2,03 %	8,32
Mexikanischer Peso	9,00 %	18,88
Südafrikanischer Rand	11,87 %	22,57
US-Dollar	5,85 %	25,88

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		
Brasilianischer Real	8,66 %	2,98
Kolumbianischer Peso	8,72 %	13,38
Euro	2,27 %	16,19
Mexikanischer Peso	7,89 %	13,80
Britisches Pfund	4,44 %	24,98
US-Dollar	5,99 %	4,49
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		
US-Dollar	4,83 %	16,10
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Euro	2,63 %	4,07

Zum 28. Februar 2023

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
US-Dollar	2,10 %	0,05
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
US-Dollar	3,91 %	17,10
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Brasilianischer Real	11,46 %	6,45
Indonesische Rupiah	6,53 %	9,13
Mexikanischer Peso	8,96 %	17,37
Russischer Rubel	0,00 %	8,80
US-Dollar	4,07 %	16,48
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Euro	1,65 %	9,72
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	4,59 %	5,01
US-Dollar	4,98 %	13,87
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Brasilianischer Real	10,92 %	3,84
Euro	5,73 %	5,10
Indonesische Rupiah	7,30 %	5,32
Mexikanischer Peso	9,03 %	19,72
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	5,29 %	6,46
Russischer Rubel	0,00 %	8,26
Südafrikanischer Rand	10,32 %	18,01
US-Dollar	5,55 %	10,34
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
US-Dollar	7,47 %	5,97
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Euro	5,46 %	4,27
Mexikanischer Peso	8,78 %	14,10
Britisches Pfund	6,55 %	3,51
Russischer Rubel	0,00 %	5,52
US-Dollar	6,10 %	6,18
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Chinesischer Renminbi	3,54 %	9,88
Indische Rupie	7,62 %	5,39
Indonesische Rupiah	7,41 %	4,02
Malaysischer Ringgit	3,94 %	8,13
Philippinischer Peso	6,58 %	12,88
Singapur-Dollar	1,62 %	11,90
Südkoreanischer Won	2,15 %	7,88
Thailändischer Baht	3,18 %	15,31
US-Dollar	3,87 %	20,28
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	1,29 %	4,27
Britisches Pfund	3,12 %	3,47
US-Dollar	2,55 %	4,41

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Brasilianischer Real	11,82 %	7,85
Kanadischer Dollar	3,15 %	12,68
Euro	2,11 %	10,77
Indonesische Rupiah	7,45 %	16,14
Japanischer Yen	0,37 %	18,27
Mexikanischer Peso	9,03 %	19,72
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	4,49 %	10,37
Südafrikanischer Rand	10,32 %	18,01
Südkoreanischer Won	1,99 %	3,28
US-Dollar	3,03 %	12,58
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Euro	1,72 %	6,04
Britisches Pfund	3,52 %	5,93
US-Dollar	5,03 %	13,42
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Australischer Dollar	3,66 %	24,07
Brasilianischer Real	11,53 %	6,58
Ägyptisches Pfund	19,19 %	1,25
Euro	6,35 %	8,93
Indische Rupie	7,41 %	4,13
Indonesische Rupiah	7,17 %	9,92
Mexikanischer Peso	9,06 %	21,28
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Russischer Rubel	0,00 %	10,55
Südafrikanischer Rand	9,68 %	14,57
US-Dollar	5,32 %	14,38
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Kanadischer Dollar	5,78 %	3,21
Euro	4,75 %	32,52
Indonesische Rupiah	6,80 %	5,57
Mexikanischer Peso	8,88 %	6,26
Britisches Pfund	6,99 %	4,12
US-Dollar	6,74 %	8,16
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
US-Dollar	6,02 %	10,84
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
US-Dollar	4,27 %	25,94
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		
Euro	2,89 %	8,65
Britisches Pfund	4,00 %	9,73
US-Dollar	4,21 %	24,53
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		
Euro	5,09 %	15,01
Mexikanischer Peso	9,10 %	15,73
Britisches Pfund	6,82 %	15,89
US-Dollar	4,80 %	9,16
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]		
Brasilianischer Real	12,15 %	9,85
Indonesische Rupiah	6,69 %	6,82
Mexikanischer Peso	9,03 %	19,72
Russischer Rubel	0,00 %	6,24
US-Dollar	4,33 %	16,65
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		
Euro	2,05 %	6,12
Britisches Pfund	2,86 %	6,35
US-Dollar	4,65 %	13,12
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Brasilianischer Real	10,44 %	2,99
Kanadischer Dollar	2,55 %	2,26
Kolumbianischer Peso	7,95 %	5,17
Euro	1,84 %	9,47
Mexikanischer Peso	8,90 %	15,49
Neuseeland-Dollar	4,24 %	16,51
Norwegische Krone	2,00 %	0,23
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	0,76 %	0,39
Russischer Rubel	8,30 %	3,38
Südafrikanischer Rand	9,63 %	16,25
Südkoreanischer Won	3,15 %	21,80
US-Dollar	2,60 %	23,18

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	11,93 %	8,54
Kolumbianischer Peso	12,00 %	20,55
Mexikanischer Peso	9,16 %	28,81
Neuseeland-Dollar	3,92 %	28,23
Peruanischer Sol	7,00 %	9,46
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Südafrikanischer Rand	11,21 %	25,02
US-Dollar	3,98 %	16,53
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Euro	3,00 %	8,47
US-Dollar	6,93 %	4,77
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Brasilianischer Real	11,43 %	6,24
Kanadischer Dollar	2,03 %	0,51
Kolumbianischer Peso	9,94 %	10,86
Euro	1,79 %	8,29
Malaysischer Ringgit	3,67 %	2,07
Mexikanischer Peso	9,05 %	18,22
Neuseeland-Dollar	3,92 %	28,23
Norwegische Krone	2,00 %	0,23
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	0,76 %	0,39
Russischer Rubel	0,00 %	7,12
Südafrikanischer Rand	10,77 %	21,57
Südkoreanischer Won	2,37 %	13,30
US-Dollar	4,05 %	26,32
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Australischer Dollar	2,79 %	7,80
Brasilianischer Real	11,75 %	9,41
Kolumbianischer Peso	9,86 %	8,08
Euro	2,01 %	28,20
Japanischer Yen	0,00 %	0,00
Mexikanischer Peso	8,86 %	28,40
US-Dollar	5,18 %	7,34
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Brasilianischer Real	12,15 %	9,85
Kolumbianischer Peso	13,18 %	27,68
US-Dollar	5,87 %	21,21
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]		
Euro	5,06 %	3,59
US-Dollar	6,47 %	4,48
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	11,60 %	6,72
Kolumbianischer Peso	9,42 %	7,79
Tschechische Krone	2,28 %	9,32
Malaysischer Ringgit	3,67 %	2,12
Mexikanischer Peso	9,03 %	17,86
Südafrikanischer Rand	11,04 %	23,65
Südkoreanischer Won	2,37 %	13,18
US-Dollar	5,27 %	23,41
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,39 %	7,67
Kolumbianischer Peso	9,86 %	8,08
Euro	1,95 %	7,29
Japanischer Yen	0,00 %	0,00
Mexikanischer Peso	7,89 %	21,98
Britisches Pfund	5,20 %	1,22
US-Dollar	5,28 %	6,84
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Euro	2,74 %	5,00

(d) Sonstige Preisrisiken – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten

Franklin Templeton hat zusätzlich zum Ausschuss den Bewertungsausschuss gegründet, um die Umsetzung der vom Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) gebilligten Bewertungsstrategien und -verfahren zu überwachen. Der Bewertungsausschuss, einschließlich des Vorsitzenden, besteht aus mindestens vier und höchstens zehn Mitgliedern. Vertreter von Franklin Templeton Legal and Compliance stehen dem Bewertungsausschuss beratend zur Seite. Der Bewertungsausschuss trifft sich monatlich, um alle Wertpapiere zu überprüfen, deren Preis manuell, von einem Makler bzw. anhand einer Matrix bestimmt wird, die zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, illiquide oder verfallen sind. Darüber hinaus kann der Bewertungsausschuss jederzeit einberufen werden, um über Fragen oder Themen zu beraten, die in seine Zuständigkeit fallen. Die Sitzungen des Bewertungsausschusses können persönlich, per E-Mail oder auf sonstige Weise schriftlich abgehalten werden.

Einige Fonds schlossen im Laufe des Jahres Derivatkontrakte ab. Der Wert von Derivaten basiert auf bestimmten zugrunde liegenden Aktien oder Anleihen, Zinssätzen, Währungen oder Indizes und umfasst Futures, Optionen, Optionen auf Futures, Differenzkontrakte und Swap-Vereinbarungen. Derivate lassen sich unter Umständen nur schwer zu einem vorteilhaften Preis oder Zeitpunkt verkaufen und reagieren empfindlich auf Veränderungen des zugrunde liegenden Wertpapiers, Zinssatzes, der Währung oder des Index. Derivate können daher sehr volatil sein und zu einem Verlust für den Fonds führen. Nähere Angaben zu den offenen Derivatpositionen am Ende des Geschäftsjahres finden Sie im Anlagenportfolio des jeweiligen Fonds.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat im Einklang mit FRS 102 beschlossen, die Bestimmungen zu Ansatz und Bewertung von International Accounting Standards („IAS“) 39 „Financial Instruments: Recognition and Measurement“ („IAS 39“) in der zur Anwendung in der Europäischen Union übernommenen Fassung und die Offenlegungsbestimmungen der Abschnitte 11 und 12 von FRS 102 anzuwenden.

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (z. B. börsengehandelte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den Kursnotierungen am Bilanzstichtag.

Steht für ein Wertpapier keine „jederzeit verfügbare Marktnotierung“ zur Verfügung, wendet die Gesellschaft „Marktwertmethoden“ an, um den Preis des Wertpapiers zu bestimmen. Generell handelt es sich beim beizulegenden Zeitwert um den Preis, mit dessen Erzielung der Fonds bei einem sofortigen Verkauf in angemessener Weise rechnen darf. Bei der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert muss der Bewertungsausschuss ausgehend von den jeweiligen Fakten und Umständen den Wert eines bestimmten Wertpapiers oder einer Gruppe von Wertpapieren in gutem Glauben bestimmen.

Umstände, unter denen keine jederzeit verfügbare Marktnotierung zur Verfügung steht, beinhalten unter anderem die Aussetzung des Handels vor der Schließung des betreffenden Marktes; Ereignisse, die unerwartet zur Schließung ganzer Märkte führen, wie beispielsweise Naturkatastrophen, Stromausfall oder ähnliche schwerwiegende Ereignisse; Feiertage ohne Handel oder das Handelsvolumen für ein bestimmtes Wertpapier.

Bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eines Portfoliowertpapiers kann der Bewertungsausschuss alle relevanten Methoden berücksichtigen, unter anderem eine oder sämtliche der nachfolgend aufgeführten Preisbestimmungsmethoden:

- (i) Gewinnkennzahlen,
- (ii) Marktabschlag eines ähnlich frei gehandelten Wertpapiers,
- (iii) Diskontierte Cashflow-Analyse,
- (iv) Buchwert oder Verhältniswert,
- (v) Risikoaufschlag/Renditeanalyse,
- (vi) Rendite bis zur Fälligkeit und/oder
- (vii) Fundamentale Investmentanalyse.

Der Bewertungsausschuss überprüft jeden Monat die Angemessenheit und Richtigkeit der für die Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts von Wertpapieren eingesetzten Methoden. Unter anderem vergleicht er dabei die jeweiligen beizulegenden Zeitwerte mit dem letzten Marktpreis und dem nächsten verfügbaren Marktpreis, beispielsweise dem Eröffnungskurs des Folgetages.

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum Marktwert im Rahmen einer Marktwerthierarchie klassifiziert, die die Signifikanz von Inputs reflektiert, die bei einer Bewertung zum Marktwert herangezogen werden. Die Marktwerthierarchie kennt folgende Stufen:

Eingabewerte der Stufe 1 sind unbereinigte notierte Kurse in aktiven Märkten für gleichartige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, welche dem Unternehmen am Bewertungstag zugänglich sind.

Eingabewerte der Stufe 2 sind andere notierte Kurse als die in aktiven Märkten der Stufe 1, welche für die betreffenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten direkt oder indirekt beobachtbar sind (d. h. unter Verwendung von Marktdaten entwickelt werden).

Eingabewerte der Stufe 3 sind nicht beobachtbare Parameter für die Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten (d. h., es sind keine Marktdaten verfügbar).

Jede Kapitalanlage wird insgesamt stets der Stufe 1, 2 oder 3 zugeordnet. In bestimmten Fällen kann zur Bewertung des beizulegenden Zeitwerts einer Kapitalanlage eine Reihe verschiedener Parameter verschiedener Stufen der Bewertungshierarchie herangezogen werden. In diesen Fällen richtet sich die Stufe der Kapitalanlage nach der geringsten Bewertungsstufe der Eingabewerte, die für die Berechnung des beizulegenden Zeitwerts herangezogen werden. Die Beurteilung der Bedeutsamkeit eines bestimmten Eingabewerts für die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert erfordert Urteilsvermögen und ist anlagenspezifisch.

Die Eingabewerte oder die verwendete Methode zur Bewertung der Wertpapiere sind nicht unbedingt ein Hinweis auf die Risiken, die mit einer Anlage in diesen Wertpapieren verbunden sind.

Die folgende Tabelle schlüsselt die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte zum 29. Februar 2024 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)			
Stufe 1										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–		
Geldmarktinstrumente		–		–		–		–		
Eigenkapitalinstrumente		–		–		–		309		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		258		9		43		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		-145		-224		-139		
		–		113		-215		213		
Stufe 2										
Anleihen und Schuldtitel	\$	816.638	\$	187.284	\$	812.104	€	47.027	\$	218.973
Anleihen und Schuldtitel		–		-740		-5.842		–		–
Geldmarktinstrumente		309.597		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		–		3.108		348		782		3.355
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		1.346		10.933		16		364
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		-1		-3.068		-15		-1.576
		1.126.235		190.997		814.475		47.810		221.116
Stufe 3										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	107	\$	961	€	–	\$	–
Geldmarktinstrumente		–		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		–		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		–		–		–		–
		–		107		961		–		–
Anlagen insgesamt	\$	1.126.235	\$	191.217	\$	816.468	€	47.595	\$	221.329

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	FTGF Western Asset US High Yield Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	2	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	8	8	–	638	52
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	-82	-82	-230
	8	10	-82	556	-178
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 94.525	\$ 47.351	\$ 242.804	\$ 463.504	\$ 127.087
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	-412
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	900	206	5.476	1.097	11.886
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	435	34	34	2.849	543
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-220	-24	-182	-675	-371
	95.640	47.567	248.132	466.775	138.733
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 248	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	333	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	581	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 96.229	\$ 47.577	\$ 248.050	\$ 467.331	\$ 138.555

	FTGF Western Asset Global Credit Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	82	22.985	647	166	313
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-21	-27.277	-262	-306	-247
	61	-4.292	385	-140	66
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 29.259	\$ 1.175.071	\$ 356.607	\$ 481.444	\$ 1.160.664
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	-6.335
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	152	44.830	161	21.501	17.502
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	90	91.549	1.799	12	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-189	-24.924	-697	-6	–
	29.312	1.286.526	357.870	502.951	1.171.831
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ 2.286	\$ 16.478	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	2.482	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	4.768	16.478	–
Anlagen insgesamt	\$ 29.373	\$ 1.282.234	\$ 363.023	\$ 519.289	\$ 1.171.897

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	76	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	97	–	256	1	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-56	–	-51	–	–
	41	–	205	77	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 17.488	\$ 142.717	\$ 138.457	\$ 29.741	\$ 204.172
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	133	2.596	8.090	718	3.580
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	519	855	3.036	38	942
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-67	-2.346	-3.927	-71	-3.847
	18.073	143.822	145.656	30.426	204.847
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 18.114	\$ 143.822	\$ 145.861	\$ 30.503	\$ 204.847

	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	11	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	55	–	14	1	14
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-274	–	-167	-4	–
	-219	11	-153	-3	14
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 1.120.544	\$ 16.728	\$ 63.604	\$ 15.252	\$ 29.635
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	20.461	1.264	3.994	579	1.040
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	6.119	–	430	54	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-6.831	–	-1.463	-57	–
	1.140.293	17.992	66.565	15.828	30.675
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 1.140.074	\$ 18.003	\$ 66.412	\$ 15.825	\$ 30.689

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	FTGF ClearBridge Value Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.142.135	210.196	1.827.864	205.138	35.735
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	1.142.135	210.196	1.827.864	205.138	35.735
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	122
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	622	–	392	7	3
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-6	–	-312	-22	-3
	616	–	80	-15	122
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 1.142.751	\$ 210.196	\$ 1.827.944	\$ 205.123	\$ 35.857

	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	€ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.367.716	16.583	807.917	326.235	5.144
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	1.367.716	16.583	807.917	326.235	5.144
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	€ –	\$ –	\$ –
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	370	–	26	255	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-16	–	-891	-124	–
	354	–	-865	131	–
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	€ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 1.368.070	\$ 16.583	€ 807.052	\$ 326.366	\$ 5.144

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	671.600	94.401	4.213	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	671.600	94.401	4.213	–	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	17.542	1.681	209	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	292	1	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-170	–	–	–	–
	17.664	1.682	209	–	–
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 689.264	\$ 96.083	\$ 4.422	€ –	\$ –

	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	122.293	20.924	31.406	186.811
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	122.293	20.924	31.406	186.811
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	1.620	142	420	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	385	–	–	3
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-22	–	–	-9
	–	1.983	142	420	-6
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ –	\$ 124.276	\$ 21.066	\$ 31.826	€ 186.805

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2028 Fund [^] zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Stufe 1		
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–
Eigenkapitalinstrumente	6.124	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–
	6.124	–
Stufe 2		
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ 85.524
Anleihen und Schuldtitel	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	5	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–
	5	85.524
Stufe 3		
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–
	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 6.129	€ 85.524

Die folgende Tabelle schlüsselt die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte zum 28. Februar 2023 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	414
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	367	3.030	480	74
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-250	-4.240	-1.069	-29
	–	117	-1.210	-589	459
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 599.348	\$ 138.314	\$ 1.182.487	€ 125.184	\$ 198.461
Geldmarktinstrumente	244.848	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	1.741	–	654	4.016
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	2.534	8.816	72	775
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-46	-4.445	-338	-4.011
	844.196	142.543	1.186.858	125.572	199.241
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 111	\$ 642	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	111	642	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 844.196	\$ 142.771	\$ 1.186.290	€ 124.983	\$ 199.700

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	FTGF Western Asset US High Yield Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	1	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	38	–	4.839	343
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-31	–	-373	-61	-1.047
	-31	39	-373	4.778	-704
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 121.003	\$ 52.582	\$ 429.611	\$ 515.122	\$ 135.809
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.661	133	3.862	17.040	11.217
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	103	60	162	3.920	1.025
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-151	-271	-1.130	-3.219	-2.097
	122.616	52.504	432.505	532.863	145.954
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 101	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	642	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	743	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 123.328	\$ 52.543	\$ 432.132	\$ 537.641	\$ 145.250

	FTGF Western Asset Global Credit Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	202	26.445	277	317	353
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-34	-86.734	-926	-73	-731
	168	-60.289	-649	244	-378
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 43.206	\$ 1.888.885	\$ 263.595	\$ 521.432	\$ 1.147.183
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	559	18.550	507	17.212	1.154
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	343	177.483	1.911	8	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-166	-93.430	-3.726	-1.683	–
	43.942	1.991.488	262.287	536.969	1.148.337
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 7.808	\$ 1.339	\$ 18.407	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	2.424	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	7.808	3.763	18.407	–
Anlagen insgesamt	\$ 44.110	\$ 1.939.007	\$ 265.401	\$ 555.620	\$ 1.147.959

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Bezulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	253	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	45	4	175	59	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-29	-103	-158	-5	–
	16	154	17	54	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	£ 43.921	\$ 93.939	\$ 15.938	\$ 8.541	\$ 160.235
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	1.342	30	4.095
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	27	35	910	92	3.132
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-7	-478	-60	-107	-3.966
	43.941	93.496	18.130	8.556	163.496
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	£ 43.957	\$ 93.650	\$ 18.147	\$ 8.610	\$ 163.496

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	22
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	2.190	2	–	–	69
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	-3.704	-175
	2.190	2	–	-3.704	-84
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 508.142	\$ 9.964	\$ 200.639	\$ 1.068.451	\$ 43.555
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	30.565	396	4.087	85.354	2.216
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	13.024	10	1.448	4.819	403
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-23.627	-202	-4.239	-13.267	-416
	528.104	10.168	201.935	1.145.357	45.758
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 530.294	\$ 10.170	\$ 201.935	\$ 1.141.653	\$ 45.674

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Value Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	2.542	921.986
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-283	-123	–	–
	–	-283	-123	2.542	921.986
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 8.077	\$ 65.808	\$ 13.130	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	411	3.886	–	41	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	249	119	–	10
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-192	-3.482	-64	-20	-976
	8.296	66.461	13.185	21	-966
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 8.296	\$ 66.178	\$ 13.062	\$ 2.563	\$ 921.020

	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	180.681	1.172.787	214.039	36.033	1.629.033
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	180.681	1.172.787	214.039	36.033	1.629.033
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 557	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	286	4	1	22
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-1.551	-229	-56	-840
	–	-1.265	-225	502	-818
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 180.681	\$ 1.171.522	\$ 213.814	\$ 36.535	\$ 1.628.215

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	12.820	1.032.510	399.290	711.568	77.554
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	12.820	1.032.510	399.290	711.568	77.554
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3	–	–	32.545	1.100
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	1.921	24	150	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-1.058	-2.229	-1.623	-2
	3	863	-2.205	31.072	1.098
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 12.823	€ 1.033.373	\$ 397.085	\$ 742.640	\$ 78.652

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	4.093	–	20.882	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	4.093	–	20.882	–	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	180	–	1	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	-90	–	–
	180	–	-89	–	–
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 4.273	€ –	\$ 20.793	\$ –	\$ –

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3.598	142.529	24.928	34.547	188.780
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	3.598	142.529	24.928	34.547	188.780
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	35	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	41	1	–	22
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-1.422	-19	–	-20
	–	-1.381	17	–	2
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 3.598	\$ 141.148	\$ 24.945	\$ 34.547	€ 188.782

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)

Stufe 1	
Anleihen und Schuldtitel	€ –
Geldmarktinstrumente	–
Eigenkapitalinstrumente	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–
	–
Stufe 2	
Anleihen und Schuldtitel	€ 34.759
Geldmarktinstrumente	–
Eigenkapitalinstrumente	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–
	34.759
Stufe 3	
Anleihen und Schuldtitel	€ –
Geldmarktinstrumente	–
Eigenkapitalinstrumente	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–
	–
Anlagen insgesamt	€ 34.759

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 GBP.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(d) Sonstige Preisrisiken – Beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

Wertpapiere, die vom Manager oder dem jeweiligen Anlageverwalter zum 29. Februar 2024 zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind im Anlagenportfolio aufgeführt. Falls kein Preis von einem Preisberechnungsdienst verfügbar ist, kann der Bewertungsausschuss eine oder mehrere indikative Notierungen von zugelassenen Broker-Dealern einholen.

Matrixpreise werden für Fonds verwendet, wenn der Bewertungsausschuss nicht in der Lage ist, einen oder mehrere Broker-Dealer-Kurse für ein Wertpapier zu erhalten, für das kein Preis von einem Preisberechnungsdienst verfügbar ist. Die Matrix-Preisermittlung schätzt den aktuellen Marktwert eines auf US-Dollar lautenden Wertpapiers, indem sie die letzte von einem Broker-Dealer erhaltene Notierung verwendet und den Preis um die Veränderung der Rendite der US-Schatzanleihe anpasst.

die hinsichtlich der Duration dem zu bewertenden Wertpapier am meisten ähnelt.

In den folgenden Tabellen ist der Wert der Wertpapiere für jeden Fonds aufgeführt, für die unter Verwendung von Single-Broker-Quellen ein Preis ermittelt wurde und die vom Bewertungsausschuss zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden:

	Single-Broker-Preis (in Tsd.)	Vom Bewertungsausschuss zum beizulegenden Zeitwert bewertet (in Tsd.)
Zum 29. Februar 2024		
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	–	107 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	346 \$	963 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	–	216 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	248 \$	860 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	–	368 \$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	–	83 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	–	5.047 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	2.286 \$	2.830 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	–	16.924 \$

	Single-Broker-Preis (in Tsd.)	Vom Bewertungsausschuss zum beizulegenden Zeitwert bewertet (in Tsd.)
Zum 28. Februar 2023		
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	111 \$	111 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	642 \$	642 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	642 \$	642 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	7.808 \$	7.808 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	2.424 \$	2.626 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	–	19.190 \$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	–	3 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	–	1 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	–	35 \$

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD oder weniger als 1.000 USD.

Nähere Angaben zu den zu Handelszwecken gehaltenen derivativen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die zum 29. Februar 2024 zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden, sind dem Anlagenportfolio zu entnehmen.

Unter bestimmten Umständen verwendet die Gesellschaft angepasste Preise von ICE Data Services („ICE“) für die Bewertung von Nicht-US-Aktien. ICE berechnet und liefert einen angepassten Schlusskurs, der als Fair-Value-Preis zu verwenden ist.

Zum 29. Februar 2024 wurden die angepassten Preise von ICE auf den FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund angewendet, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund, FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^], FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] angewendet (28. Februar 2023: Die angepassten Preise von ICE wurden auf den FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund angewendet, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] und FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]) angewendet.

12.2 Kreditrisiko

Das Kreditrisiko bezeichnet das Risiko, dass eine Gegenpartei oder der Emittent eines Finanzinstruments eine mit einem Fonds eingegangene Verpflichtung oder Verbindlichkeit nicht erfüllt. Die Gesellschaft ist bei den Parteien, mit denen sie Geschäfte abschließt, dem Kreditrisiko ausgesetzt und trägt darüber hinaus das Risiko des Zahlungsausfalls. Der jeweilige Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter minimieren die Konzentration des Kreditrisikos, indem sie mit vielen Brokern und Kontrahenten an anerkannten und namhaften Börsen Geschäfte abschließen. Alle Transaktionen mit börsennotierten Wertpapieren werden bei Auslieferung unter Inanspruchnahme zugelassener Broker abgerechnet bzw. bezahlt. Das Risiko eines Zahlungsausfalls gilt als äußerst gering, da die verkauften Wertpapiere erst ausgehändigt werden, wenn die Zahlung beim Makler eingegangen ist. Bei einem Kauf werden die Wertpapiere erst bezahlt, wenn sie beim Makler eingetroffen sind. Erfüllt eine Partei ihre Verpflichtungen nicht, kommt das Geschäft nicht zustande.

Jeder Fonds ist einem Kreditrisiko in Bezug auf die Gegenparteien ausgesetzt, mit denen er in Bezug auf Optionen, Terminkontrakte und andere Finanzderivate, die nicht an einer anerkannten Börse gehandelt werden, Geschäfte abschließt. Solche Instrumente genießen nicht den gleichen Schutz wie Teilnehmer, die an organisierten Börsen mit Swaps, Futures oder Optionen handeln, wie z. B. die Leistungsgarantie einer Börsenclearingstelle. Die Fonds sind der Möglichkeit der Insolvenz, des Konkurses oder des Ausfalls einer Gegenpartei ausgesetzt, mit der die Fonds solche Instrumente abschließen, was zu erheblichen Verlusten für die Fonds führen könnte.

Die Gesellschaft ist einem Kreditrisiko in Bezug auf die OTC-Gegenparteien ausgesetzt, mit denen sie Geschäfte abschließt. Alle OTC-Gegenparteien müssen die folgenden, in den Regulations festgelegten Kriterien erfüllen:

- Die Gegenpartei ist ein Kreditinstitut gemäß Regulation 7 der UCITS Regulations der irischen Zentralbank oder eine Investmentgesellschaft, die in Übereinstimmung mit der Richtlinie für Märkte für Finanzinstrumente in einem EWR-Mitgliedstaat zugelassen oder ein Rechtsträger ist, welcher als „Consolidated Supervised Entity“ von der Securities and Exchange Commission reguliert wird.
- Die Gegenpartei hat ein Rating von mindestens A2 oder ein gleichwertiges Rating oder nach Ansicht des jeweiligen Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter ein implizites Rating von mindestens A2 oder ein gleichwertiges Rating.

Das Engagement gegenüber einzelnen Gegenparteien ist in der Regel auf 10 % des Nettoinventarwerts bei zugelassenen Kreditinstituten und 5 % des Nettoinventarwerts bei anderen Gegenparteien begrenzt.

Transaktionen mit Finanzderivaten werden in der Regel mit Gegenparteien abgewickelt, mit denen die Gesellschaft Globalverrechnungsverträge geschlossen hat. Globalverrechnungsverträge sehen bei einem Ausfall die Nettoverrechnung von Kontrakten für einen bestimmten Fonds mit demselben Kontrahenten vor. Das Kreditrisiko im Zusammenhang mit derivativen finanziellen Vermögenswerten, die einem Globalverrechnungsvertrag unterliegen, wird nur insoweit eliminiert, als die finanziellen Verbindlichkeiten gegenüber derselben Gegenpartei nach der Realisierung der Vermögenswerte verrechnet werden.

Transaktionen, die zu hohen nicht realisierten Gewinnen für einen Fonds führen, können es erforderlich machen, dass ein Fonds von einem Broker erhaltene Sicherheiten hält. In diesen Fällen wird das Kreditrisiko für den Fonds um den Wert der gehaltenen Sicherheiten reduziert. Für den Fall, dass ein Broker Konkurs anmeldet, sind in den USA (die Vorschriften können je nach Gerichtsbarkeit variieren) Sicherheiten, die in Verbindung mit bestimmten Finanzderivaten gestellt wurden, von der automatischen Vollstreckungssperre („automatic stay“) zu Beginn eines Konkursverfahrens ausgenommen. Diese Ausnahmeregelung für Finanzderivate würde es einem Fonds ermöglichen, die von der insolventen Partei gestellten Sicherheiten sofort zu verwerten, um die Forderungen gegenüber dieser insolventen Partei zu befriedigen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

Von den folgenden Fonds zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 gehaltenen Wertpapiere, die sie als Sicherheiten im Zusammenhang mit dem Derivatehandel erhalten haben, hatten folgenden Wert:

Fonds	Broker	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
		Marktwert der Sicherheiten in Tsd.	Marktwert der Sicherheiten in Tsd.
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	BNP Paribas	79 \$	– \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Goldman Sachs	62 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	JP Morgan	69 \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	2.873 \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	BNP Paribas	8.658 \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Goldman Sachs	79 \$	567 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	JP Morgan	1.581 \$	– \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Goldman Sachs	58 \$	– \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Morgan Stanley	– \$	202 \$

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD oder weniger als 1.000 USD.

Die Gesellschaft überwacht ihr Risiko, indem sie in regelmäßigen Abständen die Kreditqualität und die Finanzlage der Gegenparteien, die die Fonds in Anspruch nehmen, überprüft. Die Fonds dürfen nur mit zugelassenen Gegenparteien Geschäfte abschließen. Es wird eine Liste der zugelassenen Gegenparteien geführt, und die Fonds dürfen nur mit diesen zugelassenen Gegenparteien Geschäfte abschließen. Aufnahmen in diese Liste werden vierteljährlich überprüft, und jährlich wird eine gründliche Neubewertung aller Gegenparteien vorgenommen. Die Überprüfung umfasst eine Analyse der Kapitaladäquanz, der Rentabilität, der Liquidität und gegebenenfalls anderer Faktoren betreffend die Gegenpartei.

Für ein effizientes Portfoliomanagement kann ein Fonds unter Einhaltung der von den UCITS Regulations der irischen Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte sowie Wertpapierleihgeschäfte abschließen.

Bis zur Fälligkeit der Pensionsgeschäfte, umgekehrten Pensionsgeschäfte und Wertpapierleihgeschäfte, müssen die im Rahmen solcher Verträge oder Transaktionen erhaltenen Sicherheiten:

- (i) täglich zum Marktwert bewertet werden,
- (ii) jederzeit dem Wert des angelegten Betrags oder der verliehenen Wertpapiere entsprechen oder diesen übersteigen,
- (iii) an den Treuhänder oder seinen Beauftragten übertragen werden und
- (iv) dem System bei einem Ausfall der Gegenpartei sofort und ohne Rückgriff auf diese zur Verfügung stehen.

Von der Gesellschaft erhaltene unbare Sicherheiten können nicht veräußert oder weiterverpfändet werden; sie müssen auf das Kreditrisiko der Gegenpartei angerechnet und von einer von der Gegenpartei unabhängigen Stelle ausgegeben werden. Das Kreditrisiko wird durch eine diversifizierte Inanspruchnahme von Gegenparteien und Emittenten sowie durch Mindestvorgaben für Ratings und durchschnittliche Portfolioratings gesteuert. Der jeweilige Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können Portfoliolimits festlegen und auf der Grundlage interner Parameter investieren, wobei bei der Auflegung eines Fonds gemeinsam vereinbarte Limits festgelegt werden, einschließlich Emissions- und Emittentenbeschränkungen, Mindestratings und eine durchschnittliche Kreditqualität. Das Konto wird laufend überwacht, um sicherzustellen, dass es diese Parameter weiterhin erfüllt. Eine strenge unabhängige Analyse aller Schuldtitel vor dem Kauf, einschließlich Finanzmodellierung, Szenarioanalyse und Überwachung von Veränderungen im Risikoprofil, kann ebenfalls durchgeführt werden. Im Allgemeinen dürfen zum Zeitpunkt des Kaufs nicht mehr als 5 % des Portfolios in einen einzelnen Unternehmensemittenten investiert werden.

Der Bewertungsausschuss tritt mindestens einmal monatlich und immer dann, wenn es die Umstände erfordern, zusammen, um Bewertungsfragen, einschließlich des Kreditrisikos, zu prüfen und zu erörtern. Der jeweilige Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter legen dem Verwaltungsrat und dem Ausschuss halbjährlich Risikoanalysen vor.

Im Wesentlichen werden alle Barmittel und Wertpapiere der Fonds über die Verwahrstelle verwaltet, die ein Rating von AA- hat (28. Februar 2023: AA-). Die Rechte der Fonds an den von der Verwahrstelle gehaltenen Barmitteln können durch Konkurs oder Zahlungsunfähigkeit der Verwahrstelle verzögert oder eingeschränkt werden. Die Bonität der Verwahrstelle wird von renommierten Ratingagenturen als erstklassig eingestuft. Wenn sich die Bonität oder die Finanzlage der Verwahrstelle erheblich verschlechtert, können der jeweilige Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter die Barbestände auf eine andere Bank übertragen.

Alle Wertpapiere, die als Sicherheiten gestellt wurden, werden im Anlagenportfolio ausgewiesen. Barmittel und Barmitteläquivalente, die bei der Verwahrstelle gehalten werden, sowie Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung werden in der Bilanz ausgewiesen.

Wenn ein Fonds einer Gegenpartei Sicherheiten gestellt hat, kann dieser Fonds im Falle einer Insolvenz der Gegenpartei gemäß den Handelsvereinbarungen mit der Gegenpartei das Recht haben, diese gestellten Sicherheiten zurückzufordern. In der Praxis kann der Fonds jedoch versuchen, die Beträge, die er der Gegenpartei zur Begleichung offener Transaktionen schuldet, zu reduzieren, indem er die geschuldeten Beträge mit den gestellten Sicherheiten verrechnet. Wenn dem Fonds nach Verrechnung mit den geschuldeten Beträgen Sicherheiten zurückfallen (z. B. wenn die Position des Fonds überbesichert wäre), hätte der Fonds im Insolvenzverfahren wahrscheinlich einen ungesicherten Anspruch gegen die Gegenpartei auf den ihm zustehenden Überschussbetrag.

Die folgende Tabelle zeigt den Marktwert der Wertpapiere, die zum 29. Februar 2024 und 28. Februar 2023 im Zusammenhang mit dem Derivatehandel als Sicherheiten bei Brokern hinterlegt wurden:

Fonds	Broker	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2023
		Marktwert der Sicherheiten in Tsd.	Marktwert der Sicherheiten in Tsd.
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	1 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Citi	– \$	152 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	69.547 \$	1.590 \$

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD oder weniger als 1.000 USD.

Um das Kontrahenten-Kreditrisiko zu mindern, werden bestimmte außerbörslich gehandelte Derivate über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Im Rahmen dieser Regelung werden die mit den Gegenparteien abgeschlossenen Geschäfte an die Clearingstellen weitergegeben, die nach ihrer Annahme die Gegenpartei in Bezug auf die Risikoaspekte des Geschäfts ersetzen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Zusammenfassung des Kreditrisikos, das auf der Bonität der in den Rentenfonds gehaltenen Schuldtitel basiert:

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund			FTGF Western Asset US Core Bond Fund			FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund			FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23
AAA	100,00 %	100,00 %	AAA	59,99 %	54,62 %	AAA	47,06 %	44,86 %	AAA	23,98 %	20,84 %
			AA	7,18 %	10,57 %	AA	5,02 %	5,62 %	AA	23,49 %	26,73 %
			A	17,05 %	16,58 %	A	17,71 %	15,52 %	A	22,24 %	23,27 %
			BBB	15,50 %	17,85 %	BBB	21,07 %	21,97 %	BBB	24,67 %	24,69 %
			BB	0,03 %	0,38 %	BB	5,26 %	8,18 %	BB	4,92 %	3,57 %
			B	0,25 %	–	B	1,42 %	1,51 %	B	0,70 %	0,90 %
						CCC & niedriger	2,46 %	2,34 %			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund			FTGF Western Asset US High Yield Fund			FTGF Western Asset Global High Yield Fund			FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23
AAA	28,44 %	12,54 %	A	0,38 %	0,24 %	AA	–	4,85 %	AAA	7,14 %	11,27 %
AA	1,43 %	1,27 %	BBB	6,74 %	5,14 %	BBB	7,57 %	3,26 %	AA	19,31 %	20,43 %
A	6,99 %	7,23 %	BB	35,66 %	30,19 %	BB	41,54 %	33,42 %	A	41,94 %	29,69 %
BBB	28,50 %	35,87 %	B	36,42 %	47,96 %	B	35,83 %	44,10 %	BBB	29,77 %	26,60 %
BB	21,21 %	27,14 %	CCC & niedriger	20,80 %	16,47 %	CCC & niedriger	15,06 %	14,22 %	BB	1,84 %	0,66 %
B	10,34 %	13,35 %				Kein Rating	–	0,15 %	Kein Rating	–	11,35 %
CCC & niedriger	2,95 %	2,40 %									
Kein Rating	0,14 %	0,20 %									
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund			FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]			FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]			FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		
Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23
AAA	6,19 %	18,93 %	AAA	46,41 %	32,86 %	AAA	0,87 %	11,77 %	AAA	16,88 %	20,30 %
AA	30,02 %	27,37 %	AA	12,16 %	15,13 %	AA	6,58 %	2,67 %	AA	1,97 %	2,80 %
A	63,79 %	53,43 %	A	20,11 %	27,67 %	A	27,18 %	21,00 %	A	7,01 %	5,42 %
BBB	–	0,27 %	BBB	15,98 %	17,24 %	BBB	55,81 %	57,17 %	BBB	49,23 %	44,03 %
			BB	4,68 %	6,19 %	BB	9,08 %	7,39 %	BB	20,36 %	22,63 %
			B	0,56 %	0,91 %	B	0,21 %	–	B	3,81 %	4,55 %
			CCC & niedriger	0,10 %	–	CCC & niedriger	0,27 %	–	CCC & niedriger	0,63 %	0,27 %
									Kein Rating	0,11 %	–
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]			FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^{^β}			FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]			FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]		
Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23
AAA	4,87 %	5,53 %	AAA	1,82 %	1,35 %	AAA	98,23 %	98,38 %	AAA	–	7,61 %
AA	0,90 %	0,66 %	AA	0,93 %	0,38 %	AA	0,23 %	0,10 %	AA	–	9,33 %
A	6,08 %	4,15 %	A	3,96 %	1,73 %	A	0,88 %	0,22 %	A	–	45,81 %
BBB	22,76 %	21,63 %	BBB	17,50 %	12,14 %	BBB	0,35 %	1,07 %	BBB	–	36,31 %
BB	34,11 %	38,14 %	BB	14,51 %	15,83 %	BB	0,21 %	0,23 %	BB	–	0,94 %
B	20,68 %	20,23 %	B	14,06 %	18,36 %	B	0,10 %	–			
CCC & niedriger	10,60 %	9,66 %	CCC & niedriger	47,22 %	50,21 %						
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]			Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]			FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]			FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23
AAA	–	0,80 %	AAA	77,49 %	6,91 %	AAA	–	9,60 %	AAA	27,10 %	55,13 %
AA	–	10,66 %	AA	2,38 %	0,42 %	AA	–	4,25 %	AA	46,86 %	9,96 %
A	–	31,89 %	A	3,53 %	1,65 %	A	–	41,98 %	A	3,24 %	8,03 %
BBB	–	45,59 %	BBB	11,69 %	34,03 %	BBB	–	39,62 %	BBB	14,08 %	18,38 %
BB	–	8,94 %	BB	0,16 %	25,58 %	BB	–	4,55 %	BB	8,72 %	8,50 %
B	–	2,04 %	B	0,77 %	8,50 %						
CCC & niedriger	–	0,08 %	CCC & niedriger	–	2,31 %						
			Kein Rating	3,98 %	20,60 %						
	0,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]			FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]			FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund			FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23
AAA	2,73 %	59,94 %	A	1,74 %	0,39 %	AAA	14,47 %	50,78 %	AAA	10,52 %	11,57 %
AA	69,71 %	2,93 %	BBB	9,61 %	7,12 %	AA	59,25 %	9,75 %	AA	8,71 %	1,61 %
A	2,04 %	9,21 %	B	34,57 %	36,83 %	A	–	8,22 %	A	5,07 %	7,74 %
BBB	16,90 %	14,30 %	BB	46,72 %	43,32 %	BBB	17,00 %	20,25 %	BBB	29,86 %	39,90 %
BB	7,56 %	13,62 %	CCC & niedriger	4,09 %	8,61 %	BB	8,31 %	10,90 %	BB	24,44 %	18,89 %
B	1,06 %	–	Kein Rating	3,27 %	3,73 %	B	0,97 %	0,02 %	B	15,91 %	14,48 %
						Kein Rating	–	0,08 %	CCC & niedriger	5,08 %	5,81 %
									Kein Rating	0,41 %	–
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]			FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]			FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]			
Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23	Rating	Feb-24	Feb-23
AAA	6,16 %	22,78 %	AAA	–	0,39 %	AAA	40,85 %	27,27 %	AAA	2,81 %	8,27 %
AA	–	9,04 %	AA	–	6,82 %	AA	2,03 %	14,11 %	AA	26,36 %	3,00 %
A	–	11,44 %	A	–	41,27 %	A	0,00 %	6,10 %	A	11,92 %	9,72 %
BBB	11,31 %	22,46 %	BBB	–	48,05 %	BBB	32,37 %	26,76 %	BBB	33,73 %	47,17 %
BB	25,04 %	9,63 %	BB	–	0,81 %	BB	21,39 %	25,76 %	BB	17,72 %	15,96 %
B	51,70 %	6,93 %	B	–	2,66 %	B	3,36 %	–	B	6,95 %	13,72 %
CCC & niedriger	5,79 %	2,22 %							CCC & niedriger	0,51 %	2,16 %
Kein Rating	–	15,50 %									
	100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]		
Rating	Feb-24	Feb-23
AAA	94,05 %	–
AA	2,07 %	–
BBB	3,88 %	–
	100,00 %	0,00 %

β Das Portfolio wird nach dem Bottom-up-Prinzip unter Anwendung des Fundamentalwertverfahrens von Western Asset zusammengestellt. Das Anlageteam verlässt sich nicht auf die Analysen der Rating-Agenturen, bewertet jedoch deren Arbeit und die Verbesserungsniveaus der Wertpapiere. Bei Wertpapieren, die nicht von einer national anerkannten statistischen Rating-Organisation (NRSRO) bewertet werden, vergibt das Anlageteam ein internes Rating, das auf der Fundamentalanalyse des Anlageteams beruht.

12.3 Liquiditätsrisiko

Der Verkaufsprospekt der Gesellschaft sieht die tägliche Ausgabe und Einziehung von Anteilen vor. Daraus resultiert für die Gesellschaft ein Liquiditätsrisiko, da sie die Rücknahmen von Anteilnehmern jederzeit erfüllen muss.

Die Verwaltungsstelle überwacht täglich die Zeichnungs- und Rücknahmeverolumina und benachrichtigt den jeweiligen Anlageverwalter oder Untereinlageverwalter gegebenenfalls über signifikante Bewegungen und ungewöhnliche Trends. Wenn die Rücknahmeanträge an einem Handelstag (wie im Prospekt definiert) 10 % der für einen Fonds ausgegebenen Anteile übersteigen, kann die Gesellschaft beschließen, die Gesamtzahl der an diesem Handelstag zurückgenommenen Anteile auf 10 % der im Umlauf befindlichen Anteile des Fonds zu beschränken; in diesem Fall werden alle betreffenden Rücknahmeanträge anteilig reduziert. Die Gesellschaft schiebt die überzähligen Rücknahmeanträge auf und behandelt die aufgeschobenen Anträge so, als ob sie für jeden folgenden Handelstag eingegangen wären (für den die Gesellschaft die gleiche Aufschiebungsbefugnis zu dem dann geltenden Grenzwert hat), bis alle Anteile, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezieht, zurückgenommen wurden. In diesen Fällen kann die Gesellschaft die Anträge am nächsten und den folgenden Handelstagen anteilig kürzen, um die oben genannte Beschränkung umzusetzen.

Die Gesellschaft kann die Bestimmung des Nettoinventarwerts eines Fonds sowie den Verkauf oder die Rücknahme von Anteilen vorübergehend in jedem Zeitraum aussetzen:

- während dessen ein Markt, welcher der wichtigste Markt für einen erheblichen Teil der Anlagen eines Fonds ist, geschlossen ist oder solange der Handel darauf eingeschränkt oder einstweilen ausgesetzt ist;
- während dessen eine Notlage besteht, infolge derer ein Fonds Anlagen, die einen wesentlichen Teil des Vermögens eines Fonds darstellen, praktisch nicht veräußern kann;
- während dessen die Preise von Anlagen eines Fonds aus irgendeinem Grund vom Fonds nicht angemessen, unverzüglich oder exakt ermittelt werden können;
- während dessen die Überweisung von Mitteln, die für Käufe und Verkäufe von Fondsanlagen benötigt werden, nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht zu üblichen Wechselkursen erfolgen kann; oder
- während dessen der Erlös aus dem Verkauf oder der Rücknahme von Anteilen nicht auf das Konto eines Fonds oder von diesem Konto überwiesen werden kann.

Die Gesellschaft ist berechtigt, zur Sicherstellung der Abwicklung kurzfristige Kredite aufzunehmen. Gemäß den UCITS Regulations darf ein Fonds nur wie folgt Geld aufnehmen:

- Ein Fonds darf im Rahmen von Parallelkrediten („Back-to-back“) Fremdwährungen kaufen.
- Ein Fonds darf Geld aufnehmen:
 - bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts, sofern eine solche Kreditaufnahme vorübergehend erfolgt, und
 - bis zu 10 % seines Nettovermögenswerts, sofern die Kreditaufnahme den Erwerb von Grundstücken ermöglichen soll, die für die Ausübung seiner Tätigkeit erforderlich sind,

vorausgesetzt, dass die unter Buchstabe b) Ziffern i) und ii) genannten Kreditaufnahmen insgesamt 15 % des Vermögens des Kreditnehmers nicht überschreiten.

Weltweite Kreditlinie (Global Credit Facility)

Die Gesellschaft nahm zusammen mit anderen in Europa und den Vereinigten Staaten eingetragenen Investmentfonds, die von Franklin Templeton Investments verwaltet werden (einzeln „der Kreditnehmer“; gemeinsam „die Kreditnehmer“), eine gemeinsame, syndizierte, vorrangige unbesicherte Kreditlinie in der Gesamthöhe von 2.675 Millionen USD auf (die „Global Credit Facility“), um für die Kreditnehmer eine Geldquelle zu schaffen, aus der sie vorübergehend und in Notfällen schöpfen können, wozu auch die Fähigkeit zählt, künftige unvorhergesehene oder ungewöhnlich umfangreiche Rücknahmeanträge bedienen zu können.

Gemäß den Bedingungen der weltweiten Kreditlinie hat die Gesellschaft, zusätzlich zu den Zinsen für jeden seitens der Gesellschaft aufgenommenen Kreditbetrag und anderen seitens der Gesellschaft entstandenen Kosten, ihren Anteil an den Gebühren und Kosten zu tragen, die im Zusammenhang mit der Einführung und Aufrechterhaltung der weltweiten Kreditlinie entstehen, und zwar auf der Grundlage ihres relativen Anteils am Gesamtvermögen aller Kreditnehmer, einschließlich einer jährlichen Bereitstellungsgebühr, die auf dem Anteil des nicht genutzten Teils dieser weltweiten Kreditlinie beruht.

Alle Fonds der Gesellschaft, mit Ausnahme des FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, fallen in den Anwendungsbereich der weltweiten Kreditlinie.

Eine der Aufgaben des Bewertungsausschusses ist die Überprüfung und Beratung bei Bewertungsfragen, einschließlich illiquider Wertpapiere. Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit in außerbörslich gehandelte Derivatkontrakte investieren, die nicht an einem organisierten öffentlichen Markt gehandelt werden und illiquide sein können. Infolgedessen ist die Gesellschaft möglicherweise nicht in der Lage, ihre Anlagen in diesen Instrumenten schnell zu einem Betrag zu liquidieren, der ihrem Marktwert nahe kommt, um ihren Liquiditätsbedarf zu decken oder auf bestimmte Ereignisse wie die Verschlechterung der Kreditwürdigkeit eines bestimmten Emittenten zu reagieren.

Die nachstehenden Tabellen wurden auf der Grundlage der nicht abgezinsten Bruttomittelabflüsse für die jeweiligen finanziellen Verbindlichkeiten erstellt. Die in den nachstehenden Tabellen aufgeführten Devisenterminkontrakte werden auf Bruttobasis abgewickelt. Nähere Angaben zu den Bruttoabrechnungsbeträgen dieser Kontrakte finden Sie im jeweiligen Anlagenportfolio.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Nachfolgend eine Auflistung der vertraglichen Fälligkeiten der finanziellen Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds:

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ 1.402	\$ 620	\$ 1.193	\$ 849	€ 60	€ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	1.640	2.826	5.946	445	7	9
Optionen	–	–	10	18	65	161	–	4
Swapkontrakte	–	–	1	46	1.640	1.867	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	12	709	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	3	7	222	1.793	212	868
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	9.918	9.879	8.473	11.726	24.808	101.191	525	187
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.318	2.054	166	132	158	148	2	1
Fällige Managementgebühr	513	363	95	71	385	487	3	3
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	30	24	18	16	57	73	8	14
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	9	1	20	20	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	49	1	1.503	1.904	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	1.114.418	833.615	185.460	131.919	815.255	1.148.700	49.829	132.467
1–3 Monate								
Optionen	–	–	6	–	25	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	1.396	1.869	15	338
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	740	–	5.842	–	–	–
Optionen	–	–	54	52	125	454	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	72	173	330	1.832	12	197
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	200	298	91	116	353	375	54	55
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 1.128.397	\$ 846.233	\$ 198.289	\$ 147.724	\$ 859.335	\$ 1.262.877	€ 50.727	€ 134.143

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Western Asset High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund [^]		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	
	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ 235	\$ 140	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	8	38	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	15	265	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	736	4	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	90	89	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	33	41	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	10	11	–	–	–	–	–	3
Fällige Informationsstellengebühren	1	4	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	103	–	1	–	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	48.519	57.431	–	–	–	–	–	–
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	9	6	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	70	94	14	14	17	17	12	42
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 49.829	\$ 58.123	\$ 15	\$ 14	\$ 17	\$ 17	\$ 12	\$ 45

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^	
zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
\$ -	\$ -	\$ -	\$ 559	\$ -	\$ 155	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
-	-	39	27	237	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	219	116	-	-	-	-
-	-	1.357	3.642	1	35	-	-	-	-
-	-	92	-	-	-	-	-	-	-
-	-	541	266	2.660	1.250	-	-	-	-
-	12	86	94	163	172	-	-	-	-
-	14	94	91	57	67	-	-	-	-
2	9	22	20	13	14	-	3	-	3
-	2	6	6	5	7	-	-	-	-
662	1.366	102	45	35	74	11	11	-	-
-	-	240.940	227.355	96.878	125.240	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	219	366	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	3	-	-	-	-	-	-
-	-	47	29	-	31	-	-	-	-
11	23	104	184	48	79	12	48	18	32
\$ 675	\$ 1.426	\$ 243.649	\$ 232.687	\$ 100.316	\$ 127.240	\$ 23	\$ 62	\$ 18	\$ 35

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		FTGF Western Asset Global Credit Fund^		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^	
zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
\$ 236	\$ 522	\$ 2	\$ 484	\$ 8	\$ -	\$ 29	\$ -	€ -	€ -
1	6	5	1	123	17	23	3	-	-
-	-	-	-	-	4	-	-	-	-
-	-	498	-	-	-	188	76	-	-
182	789	106	3.188	321	1.985	1	69	-	-
82	373	76	-	179	747	14	-	-	-
219	770	364	25.758	14.941	9.282	-	306	-	-
15	15	2	2	-	-	-	-	-	-
151	200	142	153	14	17	1	2	-	-
26	32	36	36	15	15	8	9	-	3
13	13	36	11	-	-	-	-	-	-
523	299	590	1.106	25	72	-	-	-	-
250.628	437.707	478.538	523.970	129.420	146.703	30.997	46.050	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	71	31	50	98	-	21	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	412	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	341	-	-	-	14	-	-	-	-
-	-	6	61	51	296	7	34	-	-
159	313	82	84	131	101	57	56	12	28
\$ 252.235	\$ 441.380	\$ 480.530	\$ 554.885	\$ 145.690	\$ 159.351	\$ 31.325	\$ 46.626	€ 12	€ 31

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
	Geringer als 1 Monat							
Überziehung (Barmittel)	\$ 4	\$ 83.849	\$ –	\$ –	\$ 1.022	\$ 2	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	56.547	76.579	–	–	119	119	–	–
Optionen	5.750	36.086	–	–	8	–	–	–
Swapkontrakte	18.195	43.002	–	–	286	761	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	1.589	19.856	–	–	158	2.113	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	10.696	21.228	–	–	84	63	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	97.494	4.384	–	–	3.733	7.800	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	1.269	2.062	–	–	27	24	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	80	151	–	–	29	22	–	–
Fällige Informationsstellengebühren	104	136	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.476	3.140	–	–	4	82	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	1.204.969	2.132.501	–	–	372.681	275.012	–	–
1–3 Monate								
Optionen	1.549	4.816	–	–	9	24	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	4.869	23.760	–	–	245	852	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	587	5.450	–	–	–	12	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	8.966	25.966	–	–	169	827	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	916	1.652	–	30	170	207	–	–
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 1.417.060	\$ 2.484.618	\$ –	\$ 30	\$ 378.744	\$ 287.920	\$ –	\$ –

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
	Geringer als 1 Monat							
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ 79	\$ 4	\$ 9	\$ 7	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	26	–	850	270	2.495	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	78	1.847	2.038	3.050	17.448	55	149
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	51	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	145	139	490	2.526	1.798	287	163
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	8	1
Fällige Managementgebühr	–	–	72	83	101	260	1	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	11	13	18	24	16	38	8	7
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	10	11	1	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	179	2.595	2.176	–	60	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	8.995	145.085	162.009	146.269	539.271	31.164	10.394
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	29	499	1.928	877	6.179	16	53
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	5	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	30	31	343	386	228	247	41	44
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 41	\$ 9.322	\$ 148.271	\$ 170.418	\$ 155.574	\$ 567.743	\$ 31.640	\$ 10.811

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	
zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
\$ 533	\$ –	\$ 3.121	\$ 878	£ –	£ –	\$ –	\$ –	\$ 119	\$ –
–	–	72	54	–	–	–	6	105	389
–	–	–	–	–	–	–	–	6	21
6	1.683	–	–	–	–	–	74	4	2
–	–	–	–	–	–	–	361	–	–
–	–	250.542	83.125	–	229	–	1.787	5	55
43	77	15	13	–	–	–	–	137	193
39	38	77	69	3	11	6	12	–	–
1	2	–	–	–	–	–	–	17	31
98	–	–	–	–	–	28	–	–	–
526.156	559.548	1.149.708	1.119.507	–	45.912	–	94.775	18.396	18.441
–	–	–	–	–	–	–	–	–	1
–	–	–	–	–	7	–	43	62	58
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	6.335	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	12	16
306	73	247	731	–	29	–	–	–	–
284	350	197	222	43	45	89	64	34	65
\$ 527.466	\$ 561.771	\$ 1.410.314	\$ 1.204.599	£ 46	£ 46.233	\$ 123	\$ 97.229	\$ 18.944	\$ 19.324
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	
zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
\$ 1	\$ 3	\$ –	\$ –	\$ 3.226	\$ 1	\$ 152	\$ –	\$ –	\$ 103
320	110	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	2.085	878	–	37	–	–
3.062	1.723	–	–	4.746	11.891	–	311	–	144
–	–	–	–	274	2.581	–	175	–	–
–	9.308	–	–	4.968	5.978	663	–	–	30
–	–	–	–	147	106	–	–	–	–
105	100	–	–	681	701	3	39	–	–
22	27	–	–	82	77	13	20	2	7
–	1	–	–	74	78	–	–	–	1
16	4	–	–	4.823	714	5.311	–	–	–
207.376	205.146	–	–	1.151.380	1.210.305	16.403	46.756	–	8.389
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
785	2.507	–	–	–	498	–	68	–	48
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	9	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	1.123	–	–	–	–
128	148	2.172	2.173	349	128	80	66	13	60
\$ 211.815	\$ 219.086	\$ 2.172	\$ 2.173	\$ 1.172.835	\$ 1.235.059	\$ 22.625	\$ 47.472	\$ 15	\$ 8.782

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global-US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	
	zum	zum	zum	zum	zum	zum	zum	zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 1	\$ 9	\$ –	\$ 218	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	288	122	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	1.163	3.010	56	44	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	167	283	4	109	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	–	327	209	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	–	–	11	13	20	4	4	–
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	15	–	–	–	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	–	71.037	69.410	15.829	14.804	31.699	–
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	300	462	1	20	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	10	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	14	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	171	132	57	27	21	–
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 15	\$ –	\$ 73.138	\$ 73.770	\$ 16.185	\$ 15.022	\$ 31.942	\$ –

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	
	zum	zum	zum	zum	zum	zum	zum	zum
	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023	29. Februar 2024	28. Februar 2023
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ 2	\$ 5	\$ –	\$ –	\$ 74	\$ –	\$ 5.786	\$ 7
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	304	1.284	22	229	3	56	16	840
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	18.684	429	28	179	3	–	10.962	3.682
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	1.176	795	196	200	20	33	583	704
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	189	165	40	43	10	11	105	130
Fällige Informationsstellengebühren	154	109	36	35	–	4	115	170
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.792	3.685	208	176	34	44	6.183	28.161
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	1.872.600	1.225.735	207.390	224.793	35.936	38.528	1.365.510	1.639.979
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	8	267	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	179	368	174	224	55	47	159	111
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 1.896.088	\$ 1.232.842	\$ 208.094	\$ 225.879	\$ 36.135	\$ 38.723	\$ 1.389.419	\$ 1.673.784

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
\$ -	\$ -	\$ 614	\$ 2.030	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 6	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	20	6	976	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	3.823	6.635	-	-	-	-	-	43
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	715	609	-	-	-	-	185	165
3	7	90	86	-	-	-	-	26	27
-	-	57	56	-	-	-	-	28	23
-	-	4.096	288	17	29	-	-	562	55
-	2.534	1.157.626	929.726	-	-	-	-	211.456	189.610
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	50	94	118	-	30	1	55	86	81
\$ 22	\$ 2.611	\$ 1.167.121	\$ 940.524	\$ 17	\$ 59	\$ 1	\$ 55	\$ 212.349	\$ 190.004
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	
zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
\$ -	\$ -	€ 1	€ 2	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 6	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	891	1.018	-	-	124	2.229	-	-
52	-	450	2.286	-	-	5.843	3.872	3	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	6	655	826	-	-	296	377	-	-
8	9	69	103	-	3	28	31	10	-
-	-	76	99	-	-	51	74	-	-
50	-	3.388	1.022	-	-	989	2.062	-	-
16.718	13.179	822.923	1.062.833	-	-	331.809	406.048	5.641	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	40	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
41	27	104	94	24	47	64	62	15	-
\$ 16.872	\$ 13.221	€ 828.557	€ 1.068.323	\$ 24	\$ 50	\$ 339.204	\$ 414.761	\$ 5.669	\$ -

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]	
	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
Verbindlichkeiten (in Tsd.)								
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ 4	\$ 643	\$ –	\$ 142	\$ 8	\$ –	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	169	1.547	–	2	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	1.393	1.944	343	358	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	595	624	97	83	–	1	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	74	82	15	16	6	7	–	–
Fällige Informationsstellengebühren	111	109	12	12	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.599	915	25	37	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	694.890	741.529	95.935	78.098	4.386	4.254	–	–
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	1	76	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	161	207	61	68	40	19	23	23
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 700.997	\$ 747.676	\$ 96.488	\$ 78.816	\$ 4.440	\$ 4.281	\$ 23	\$ 23

	Legg Mason Japan Equity Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	
	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
Verbindlichkeiten (in Tsd.)								
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	¥ –	¥ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	€ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	–	2	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	–	–	3	14	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	3.538	–	–	–	–
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	126.058	114.974	54	74	28	28	83	65
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	¥ 126.058	¥ 114.974	\$ 57	\$ 3.628	\$ 28	\$ 28	€ 83	€ 65

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund [^]		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	
zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
€ -	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	90	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	25	-	-	-	-	-	-
-	3	2	11	-	-	-	-	-	4
-	-	-	2	-	-	-	-	-	-
1.175	1.185	2.213	-	59	59	1	2	2.517	2.516
-	-	-	21.090	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
253	71	49	133	2	1	37	39	27	49
€ 1.428	€ 1.259	\$ 2.264	\$ 21.351	\$ 61	\$ 60	\$ 38	\$ 41	\$ 2.544	\$ 2.569
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]		FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	
zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 180	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	22	1.422	-	19	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	63	154	507	-	75	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	64	76	8	18	16	26
-	-	-	-	16	19	8	9	10	11
-	-	-	-	7	8	-	3	-	1
51	51	38	38	89	184	5	-	40	-
-	-	-	-	124.021	141.049	21.144	25.121	31.647	34.702
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	23	23	51	45	177	95	172	116
\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 61	\$ 124.513	\$ 142.957	\$ 21.849	\$ 25.265	\$ 31.960	\$ 34.856

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]		Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	
	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2023
Geringer als 1 Monat						
Überziehung (Barmittel)	€ –	€ 3	\$ –	\$ –	€ –	€ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	9	1	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	4.372	–	–	–	815
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	54	55	–	–	32	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	23	41	21	–	9	2
Fällige Informationsstellengebühren	1	1	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	2.603	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	188.878	189.097	6.186	–	87.704	36.823
1–3 Monate						
Optionen	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	19	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate						
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	40	37	44	–	43	22
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	€ 189.005	€ 196.229	\$ 6.251	\$ –	€ 87.788	€ 37.662

13. Angaben zu Kreuzbeteiligungen von Fonds innerhalb der Gesellschaft

Bestimmte Fonds investieren in andere Fonds der Gesellschaft. Diese Kreuzbeteiligungen wurden im Jahresabschluss der Gesellschaft wie folgt eliminiert:

- Die Marktwerte der zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen wurden in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft in der Bilanz eliminiert.
- Die realisierten Gewinne und Verluste, einschließlich der Veränderungen bei den nicht realisierten Gewinnen und Verlusten, sowie die entsprechenden Dividenderträge und Ausschüttungen aus den Kreuzbeteiligungen wurden in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft, die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen werden, eliminiert.
- Die Geldbeträge der Käufe und Verkäufe von Anteilen an solchen Organismen für gemeinsame Anlagen wurden von den Nettoerlösen aus Anteilsverkäufen bzw. den Kosten der zurückerworbenen Anteile in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft, die in der Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens ausgewiesen sind, abgezogen.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] hielt zum Jahresende 29.816 (2023: 29.816) Anteile am FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]. Transaktionen mit diesen Anteilen und damit verbundene Gewinne, Verluste und Ausschüttungen während des Geschäftsjahres:

	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	
	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	– \$	– \$
Rücknahme von Anteilen	–	–
Realisierter Nettogewinn aus zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewerteten Finanzanlagen	–	–
Erhaltene Ausschüttungen	–	–
Kosten	3.500	3.500
Beizulegender Zeitwert	3.994	3.886
Nicht realisierter Nettogewinn aus zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewerteten Finanzanlagen	494 \$	386 \$

14. Bedeutende Ereignisse

Mit Wirkung vom 24. März 2023 haben der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 20. April 2023 hat der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] den Handel eingestellt.

Am 12. Juni 2023 wurden von der Gesellschaft ein Nachtrag zum FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^], ein ergänzender Verkaufsprospekt und ein spezieller Verkaufsprospekt für Franklin Templeton Global Funds Plc herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 hat der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel aufgenommen.

Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 hat der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 trat William Jackson als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft zurück.

Mit Wirkung vom 27. Juli 2023 wurde Craig Tyle als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

Am 18. September 2023 wurden von der Gesellschaft ein Nachtrag zum FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^], ein ergänzender Verkaufsprospekt und ein aktualisierter Prospekt für Franklin Templeton Global Funds Plc herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Mit Wirkung vom 22. September 2023 hat der FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^] den Handel aufgenommen.

Mit Wirkung vom 23. Oktober 2023 hat der FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] den Handel eingestellt.

Am 1. November 2023 wurde von der Gesellschaft ein Nachtrag für den FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^] zum Verkaufsprospekt von Franklin Templeton Global Funds Plc und der spezielle Verkaufsprospekt für Franklin Templeton Global Funds Plc mit Datum vom 1. November 2023 herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Der Nachtrag mit den bestehenden Fonds der Gesellschaft, datiert vom 1. November 2023, wurde ebenfalls herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Mit Wirkung vom 3. November 2023 wurde Elinor Murray als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

14. Signifikante Ereignisse – (Fortsetzung)

Mit Wirkung vom 6. November 2023 hat der FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^] den Handel aufgenommen.

Mit Wirkung vom 10. November 2023 hat der FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 5. Dezember 2023 hat der FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

Am 26. Januar 2024 wurde ein Nachtrag für den FTGF Western Asset US Core Bond Fund von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Die wesentliche Änderung war die Berichtigung der maximalen Verwaltungsgebühr der Anteilklasse F.

Mit Wirkung vom 21. Februar 2024 trat Jane Trust als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft zurück.

Am 21. Februar 2024 wurden ein Nachtrag für den Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] (ehemals Franklin Responsible Series 2 Fund[^], umbenannt am 21. Februar 2024) und ein ergänzender Prospekt für Franklin Templeton Global Funds Plc von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Während des Geschäftsjahres zum 29. Februar 2024 fanden keine sonstigen bedeutenden Ereignisse statt.

15. Getrennte Haftung

Die Gesellschaft ist ein Umbrella-Fonds mit getrennt haftenden Fonds. Daher können die Vermögenswerte der einzelnen Fonds nach irischem Recht nicht für Verbindlichkeiten der anderen Fonds der Gesellschaft herangezogen werden. Ungeachtet der obigen Ausführungen kann nicht garantiert werden, dass die getrennte Haftung der Teilfonds im Fall einer Klage gegen die Gesellschaft vor einem Gericht eines anderen Rechtssystems Bestand hat.

16. Ereignisse nach dem Stichtag

Am 14. März 2024 wurde von der Gesellschaft ein aktualisierter Nachtrag für den Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Mit Wirkung vom 27. März 2024 hat der Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] den Handel aufgenommen.

Mit Wirkung vom 1. April 2024 ist der Gesellschaftssekretär von Bradwell Limited zu OGS Corporate Governance Limited gewechselt.

Am 30. April 2024 wurden die Zulassungen des Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund[^] und Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund[^] auf Antrag der Gesellschaft von der Zentralbank widerrufen.

Am 31. Mai 2024 wurde eine neue Fassung des Prospekts von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Der Hauptzweck der Aktualisierung des Prospekts bestand darin, die Änderung der Namenskonvention für verschiedene Anteilsklassen der Gesellschaft zu ermöglichen. Darüber hinaus änderte der FTGF ClearBridge Value Fund seinen Namen in FTGF ClearBridge US Value Fund. Bitte beachten Sie außerdem, dass bei einigen Fonds zusätzliche Änderungen vorgenommen wurden, wie in der Mitteilung an die Anteilsinhaber vom 12. April 2024 dargelegt.

Darüber hinaus wurde die Anlagepolitik für den FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund ebenfalls wesentlich geändert. Diese Änderungen umfassen: (i) Verringerung des Engagements in Schwellenländern, (ii) Änderungen der Limits für die durchschnittliche gewichtete Duration, (iii) Änderung der Benchmark, (iv) Änderung der angestrebten Renditen und (v) Einführung von Limits für das Währungsengagement. Die Änderungen der Anlagepolitik wurden von den Anteilsinhabern des Fonds auf einer außerordentlichen Hauptversammlung am 8. Mai 2024 genehmigt und von der Zentralbank am 31. Mai 2024 zur Kenntnis genommen.

Mit Wirkung zum 17. Juli 2024 wird der Handel mit dem FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund eingestellt.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die eine Offenlegung im Jahresabschluss erfordern.

17. Genehmigung des Jahresberichts und des geprüften Abschlusses

Der Verwaltungsrat genehmigte den Jahresbericht und den geprüften Abschluss am 13. Juni 2024.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	0,65	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	0,65	
Klasse B USD, thesaurierend	1,20	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,10	
Klasse C USD, thesaurierend	1,35	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,45	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	0,65	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	0,65	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	0,68	
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,08	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,08	
Klasse C USD, thesaurierend	1,58	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,58	
Klasse E USD, thesaurierend	1,69	
Klasse F USD, thesaurierend	0,62	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,62	
Klasse X USD, thesaurierend	0,58	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,58	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,58	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,14	
Klasse GA USD, thesaurierend	0,96	
Klasse GE USD, thesaurierend	1,56	
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,25	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,25	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,25	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,27	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,25	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,51	
Klasse C USD, thesaurierend	1,75	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,75	
Klasse E USD, thesaurierend	1,85	
Klasse F USD, thesaurierend	0,66	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,65	
Klasse X USD, thesaurierend	0,55	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,55	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,56	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,40	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,40	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,45	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,11	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,12	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,10	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,25	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,25	
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	1,76	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,75	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,75	
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,17	
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	1,13	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,63	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,48	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,16	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,00	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,00	
Klasse GE EUR, thesaurierend	1,60	
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,38	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,38	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,38	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,38	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,38	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,38	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,38	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,38	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,38	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,38	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,38	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,63	
Klasse C USD, thesaurierend	1,88	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,88	
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,40	
Klasse E USD, thesaurierend	1,98	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,98	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,98	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,99	
Klasse F USD, thesaurierend	0,79	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,78	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,83	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,83	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,54	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,53	
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,53	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,53	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,53	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,53	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,53	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,53	
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,13	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,13	
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,24	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,24	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,24	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,24	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,24	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,25	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,24	
Klasse C USD, thesaurierend	1,74	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,74	
Klasse E USD, thesaurierend	1,85	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,85	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,85	
Klasse F USD, thesaurierend	0,85	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,85	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,60	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,60	
Klasse S USD, ausschüttend (M)	0,45	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,45	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,15	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,15	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,30	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,30	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,80	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,80	
Klasse GF USD, thesaurierend	1,10	

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,25	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,25	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,25	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,25	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,25	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,25	
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,25	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,25	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,50	
Klasse C USD, thesaurierend	1,75	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,75	
Klasse E USD, thesaurierend	1,97	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,97	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,97	
Klasse F USD, thesaurierend	0,96	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,97	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,87	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,72	
Klasse S USD, ausschüttend (M)	0,45	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,45	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,52	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,52	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	2,02	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	2,02	
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,38	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,37	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse B USD, thesaurierend	1,62	
Klasse C USD, thesaurierend	1,87	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,87	
Klasse E USD, thesaurierend	1,97	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,97	
Klasse F USD, thesaurierend	0,97	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,97	
Klasse X USD, ausschüttend (M)	0,87	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,72	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M)	0,72	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	0,72	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,12	
Klasse LM EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,12	
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,12	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,12	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,12	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,12	
Klasse A SEK, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,00	
Klasse C USD, thesaurierend	1,62	
Klasse C USD, ausschüttend (M)	1,62	
Klasse E USD, thesaurierend	1,72	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,71	
Klasse F USD, thesaurierend	0,72	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,71	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,62	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,47	
Klasse Premier CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,48	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,46	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,47	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,47	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,48	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,37	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,37	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,37	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,37	
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,19	
Klasse X USD, thesaurierend	0,69	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,56	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,56	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,55	
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)	0,55	
Klasse S USD, thesaurierend	0,45	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,45	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,17	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,16	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,17	
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,27	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,28	
Klasse X USD, thesaurierend	0,65	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,28	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,29	
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,74	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,74	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,73	
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Klasse C USD, thesaurierend	2,24	
Klasse C USD, ausschüttend (S)	2,24	
Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse E USD, thesaurierend	2,34	
Klasse E USD, ausschüttend (S)	2,34	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,34	
Klasse F USD, thesaurierend	1,34	
Klasse F USD, ausschüttend (S)	1,34	
Klasse X USD, thesaurierend	1,24	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,23	
Klasse X USD, ausschüttend (S)	1,24	
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,24	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,24	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,24	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,24	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,24	
Klasse X SGD thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,08	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	1,09	
Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1,08	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,09	
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse S USD, thesaurierend	0,69	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,68	
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,09	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,09	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,52	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,52	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,52	
Klasse C USD, thesaurierend	2,05	
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,90	
Klasse S USD, thesaurierend	0,52	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
Klasse S CHF, ausschüttend (A)	0,52	
Klasse S CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,52	
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,46	
Klasse D USD, thesaurierend	1,45	
Klasse D USD, ausschüttend (M)	1,46	
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,46	
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse M USD, ausschüttend (M)	0,86	
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,70	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,27	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,40	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]		
Klasse LM USD, ausschüttend (Q)	n/a	
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,41	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,41	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,41	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,40	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,41	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,41	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,40	
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	1,41	
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,41	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,41	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,41	
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,41	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,39	
Klasse B USD, thesaurierend	1,67	
Klasse B USD, ausschüttend (S)	1,66	
Klasse C USD, thesaurierend	1,91	
Klasse C USD, ausschüttend (S)	1,91	
Klasse E USD, thesaurierend	2,01	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	2,01	
Klasse F USD, thesaurierend	1,01	
Klasse F USD, ausschüttend (S)	1,01	
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,01	
Klasse X USD, thesaurierend	0,91	
Klasse X USD, ausschüttend (S)	0,91	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,90	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,91	
Klasse X GBP, thesaurierend	0,91	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,91	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,91	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,91	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,91	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,76	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	0,75	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,76	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,76	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,76	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,76	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,76	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,76	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,16	
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,16	
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,63	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,64	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,63	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,60	
Klasse C USD, thesaurierend	2,15	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,23	
Klasse F USD, thesaurierend	1,21	
Klasse X USD, thesaurierend	1,17	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,17	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,17	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,03	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,02	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,04	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,14	
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,40	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,90	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,75	
Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	0,48	
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,48	
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,43	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,43	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,45	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,42	
Klasse C USD, thesaurierend	1,94	
Klasse E USD, thesaurierend	2,04	
Klasse F USD, thesaurierend	1,04	
Klasse F USD, ausschüttend (M)	1,04	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,93	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,93	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,79	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,79	
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,79	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,13	
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,14	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,37	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,40	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,37	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,37	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,37	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse C USD, thesaurierend	1,87	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,87	
Klasse A CZK, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse E USD, thesaurierend	1,97	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,97	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse F USD, thesaurierend	0,92	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,92	
Klasse X USD, thesaurierend	0,72	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,75	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,72	
Klasse X EUR, thesaurierend	0,72	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,72	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,72	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,57	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,57	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,57	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,57	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,57	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,57	
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	0,57	
Klasse S USD, thesaurierend	0,47	
Klasse S USD, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,47	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,47	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,47	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,47	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,12	
Klasse LM USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,13	
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	0,12	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,95	
Klasse X USD, ausschüttend (M)	1,45	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,30	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15	
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	2,29	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	2,29	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,45	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,15	
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,40	
Klasse S USD, thesaurierend	0,45	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,45	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,45	
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,09	
Klasse S USD, thesaurierend	0,35	
FTGF ClearBridge Value Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,81	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,81	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,81	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,81	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,81	
Klasse A GBP ausschüttend (A)	1,81	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,81	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,81	
Klasse C USD, thesaurierend	2,31	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,31	
Klasse E USD, thesaurierend	2,56	
Klasse F USD, thesaurierend	1,21	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,21	
Klasse U USD, thesaurierend	0,63	
Klasse X USD, thesaurierend	1,13	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,13	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,14	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,79	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,79	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,79	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,78	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,78	
LM Klasse USD, ausschüttend (A)	0,11	
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,74	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,75	
Klasse B USD, thesaurierend	2,24	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,24	
Klasse C USD, thesaurierend	2,24	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,24	
Klasse E USD, thesaurierend	2,50	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,50	
Klasse F USD, thesaurierend	1,15	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,15	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,12	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,12	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,77	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,77	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,77	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,15	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,40	
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,35	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,90	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,57	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,57	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,57	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,32	
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,32	
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,70	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,70	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,70	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,70	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,75	
Klasse B USD, thesaurierend	2,20	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,20	
Klasse C USD, thesaurierend	2,20	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,20	
Klasse E USD, thesaurierend	2,45	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,45	
Klasse F USD, thesaurierend	1,10	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,10	
Klasse U USD, thesaurierend	0,62	
Klasse U USD, ausschüttend (Q)	0,63	
Klasse U EUR, thesaurierend	0,63	
Klasse X USD, thesaurierend	1,07	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,07	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,07	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,07	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,72	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,72	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,72	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,35	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,85	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,52	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,52	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,79	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,79	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,79	
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,79	
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,79	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,79	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,79	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,79	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,79	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,79	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,79	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,79	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,30	
Klasse C USD, thesaurierend	2,29	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,29	
Klasse E USD, thesaurierend	2,54	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,54	
Klasse E EUR, thesaurierend	2,54	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,54	
Klasse F USD, thesaurierend	1,19	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,19	
Klasse X USD, thesaurierend	1,14	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,14	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,14	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,14	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,14	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,79	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,79	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,80	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,79	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,79	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,79	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,14	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,44	
Klasse B (G) USD, thesaurierend	1,94	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,94	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,56	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,56	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,31	
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,31	
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,75	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,74	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,74	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,74	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,74	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,74	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,74	
Klasse C USD, thesaurierend	2,24	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,24	
Klasse C USD, ausschüttend (Q)	2,24	
Klasse F USD, thesaurierend	1,15	
Klasse F EUR, thesaurierend	1,15	
Klasse F EUR, ausschüttend (A)	1,15	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,13	
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,67	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,67	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,67	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,67	
Klasse A SEK, thesaurierend	1,50	
Klasse F USD, thesaurierend	1,07	
Klasse X USD, thesaurierend	1,07	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,06	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,07	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,07	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,06	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,06	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,72	
Klasse S USD, thesaurierend	0,52	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,52	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,52	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	0,52	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,12	
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,79	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,80	
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,96	
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	2,00	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,97	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,96	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,97	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	1,97	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse C USD, thesaurierend	2,47	
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	2,47	
Klasse E USD, thesaurierend	2,71	
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2,71	
Klasse E EUR, thesaurierend	2,73	
Klasse E EUR, ausschüttend (A)	2,75	
Klasse F USD, thesaurierend	1,37	
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse U EUR, thesaurierend	0,73	
Klasse X USD, thesaurierend	1,06	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,07	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,06	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,06	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,07	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	0,87	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,86	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,86	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	0,87	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,97	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,97	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,97	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,98	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)	1,98	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,98	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,97	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse U USD, thesaurierend	0,73	
Klasse U USD, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,72	
Klasse U EUR, thesaurierend	0,72	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)	0,73	
Klasse A GBP, thesaurierend	0,73	
Klasse U GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,73	
Klasse U GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	0,73	
Klasse U GBP, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,73	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,22	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,23	
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,23	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,22	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,88	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus	0,88	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,88	
Klasse S USD, thesaurierend	0,53	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,53	
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,80	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,80	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,80	
Klasse S USD, thesaurierend	0,45	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,45	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,45	
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,97	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,97	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,97	
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,97	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,97	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse B USD, thesaurierend	2,47	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,47	
Klasse C USD, thesaurierend	2,47	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,47	
Klasse E USD, thesaurierend	2,72	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,72	
Klasse E EUR, thesaurierend	2,72	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,72	
Klasse F USD, thesaurierend	1,37	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,37	
Klasse R EUR, thesaurierend	1,47	
Klasse X USD, thesaurierend	1,22	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,22	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,22	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,22	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,22	
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	1,22	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,99	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	2,04	
Klasse A EUR, thesaurierend	2,04	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,04	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	2,04	
Klasse A GBP ausschüttend (A)	2,04	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	2,03	
Klasse C USD, thesaurierend	2,49	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,54	
Klasse E USD, thesaurierend	2,79	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,79	
Klasse E EUR, thesaurierend	2,79	
Klasse F USD, thesaurierend	1,44	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,44	
Klasse R USD, thesaurierend	1,53	
Klasse X USD, thesaurierend	1,29	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,28	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,94	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,94	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,94	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,19	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,44	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,94	
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,99	
Klasse X USD, thesaurierend	1,23	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,25	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90	
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,99	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,98	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,99	
Klasse C USD, thesaurierend	2,48	
Klasse E USD, thesaurierend	2,73	
Klasse F USD, thesaurierend	1,39	
Klasse X USD, thesaurierend	1,24	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,24	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,24	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,89	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,88	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,54	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,54	
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	2,00	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,99	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus	1,99	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)	1,99	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	2,00	
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60	
Klasse D CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60	
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus	1,60	
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60	
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,60	
Klasse D USD, thesaurierend	1,60	
Klasse X AUD, thesaurierend	1,25	
Klasse X USD, thesaurierend	1,25	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,59	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	0,59	
Klasse LM AUD, thesaurierend	0,15	
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,99	
Klasse E USD, thesaurierend	2,74	
Klasse F USD, thesaurierend	1,40	
Klasse X USD, thesaurierend	1,25	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90	
Klasse S USD, thesaurierend	0,70	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,70	
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,97	
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2,72	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,22	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,87	
Klasse S USD, thesaurierend	0,50	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,47	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,47	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024**
FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]	
Klasse A USD, thesaurierend	1,99
Klasse X GBP, thesaurierend	1,25
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,25
Klasse S USD, thesaurierend	0,15
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,15
Klasse S GBP, thesaurierend	0,15
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,15
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]	
Klasse A EUR, thesaurierend	0,74
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	0,74
Klasse D EUR, thesaurierend	1,29
Klasse D EUR, ausschüttend (A)	1,29
Klasse X EUR, thesaurierend	0,34
Klasse X EUR, ausschüttend (A)	0,34

Die Berechnungsmethode für die Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) ist auf der Website der Asset Management Association Switzerland (AMAS) (www.am-switzerland.ch) beschrieben.

(1) WE = Währungseinheiten in der Rechnungslegungswährung des Fonds.

** Für Zeiträume unter einem Jahr auf das Jahr hochgerechnet.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Klasse A USD, thesaurierend	08.05.2007	USD	4,71 %	4,53 %	5,77 %	10,57 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	4,70 %	4,52 %	5,74 %	10,60 %
	Klasse B USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	4,27 %	4,07 %	5,05 %	8,24 %
	Klasse B USD, ausschüttend (D)	20.04.2022	USD	4,22 %	4,05 %	–	–
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	3,97 %	3,80 %	4,62 %	7,04 %
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	10.10.2018	USD	4,91 %	4,73 %	6,09 %	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	4,70 %	4,53 %	5,76 %	10,57 %
	Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	4,71 %	4,52 %	5,75 %	10,55 %
	Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	4,71 %	4,53 %	5,78 %	10,58 %
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09.05.2007	USD	2,77 %	5,95 %	-14,12 %	10,10 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	30.08.2002	USD	2,76 %	5,95 %	-14,14 %	9,84 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	2,26 %	5,43 %	-15,39 %	4,74 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	2,25 %	5,43 %	-15,40 %	4,49 %
	Klasse E USD, thesaurierend	16.08.2019	USD	2,15 %	5,29 %	-15,71 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	09.08.2013	USD	3,30 %	6,46 %	-12,89 %	15,70 %
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	27.02.2017	USD	3,35 %	6,51 %	-12,85 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	13.05.2016	USD	3,28 %	6,49 %	-12,85 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	03.05.2016	USD	3,27 %	6,48 %	-12,86 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	19.04.2017	USD	3,40 %	6,58 %	-12,36 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	08.04.2021	USD	3,75 %	6,93 %	–	–
	Klasse GA USD, thesaurierend	27.08.2010	USD	2,90 %	6,07 %	-13,68 %	12,52 %
	Klasse GE USD, thesaurierend	27.08.2010	USD	2,27 %	5,42 %	-15,22 %	5,95 %
	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	3,07 %	6,18 %	-15,27 %
Klasse A USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	3,07 %	6,18 %	-15,28 %	8,95 %
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		19.02.2016	USD	3,08 %	6,18 %	-15,27 %	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		19.02.2016	AUD	1,29 %	4,28 %	-18,00 %	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		12.06.2018	EUR	0,95 %	3,81 %	-19,82 %	–
Klasse B USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	2,79 %	5,90 %	-16,05 %	6,16 %
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	2,55 %	5,64 %	-16,53 %	3,60 %
Klasse C USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	2,55 %	5,65 %	-16,53 %	3,63 %
Klasse E USD, thesaurierend		03.02.2012	USD	2,45 %	5,54 %	-16,79 %	2,55 %
Klasse F USD, thesaurierend		05.04.2013	USD	3,69 %	6,81 %	-13,58 %	17,03 %
Klasse F USD, ausschüttend (D)		31.10.2018	USD	3,67 %	6,80 %	-13,59 %	–
Klasse X USD, thesaurierend		20.03.2015	USD	3,80 %	6,92 %	-13,63 %	–
Klasse X USD, ausschüttend (D)		28.11.2017	USD	3,77 %	6,89 %	-13,63 %	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		10.10.2019	EUR	1,60 %	4,47 %	-18,39 %	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		14.09.2010	USD	3,95 %	7,08 %	-12,93 %	19,99 %
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		29.09.2011	USD	3,96 %	7,07 %	-12,93 %	19,91 %
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		02.03.2016	EUR	1,72 %	4,62 %	-17,60 %	–
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		13.08.2021	USD	4,26 %	7,40 %	–	–
Klasse LM EUR, thesaurierend		05.04.2016	EUR	1,89 %	3,99 %	-2,92 %	–
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		19.11.2010	GBP	3,54 %	6,52 %	-14,03 %	13,88 %
Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	3,07 %	6,17 %	-15,12 %	10,22 %	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	3,06 %	6,17 %	-15,12 %	10,21 %	
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	2,58 %	5,66 %	-16,32 %	5,11 %	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	2,56 %	5,64 %	-16,39 %	4,85 %	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	2,54 %	5,63 %	-16,39 %	4,85 %	
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Klasse A USD, ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	7,50 %	10,54 %	-23,42 %	-22,03 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (D)	30.09.2003	EUR	5,14 %	7,13 %	-15,26 %	1,97 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	6,90 %	9,93 %	-24,47 %	-23,60 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	01.03.2019	EUR	5,83 %	7,82 %	-13,38 %	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend	02.05.2017	EUR	6,14 %	8,14 %	-12,59 %	–
	Klasse GA EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	5,28 %	7,26 %	-14,72 %	4,96 %
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	27.08.2010	EUR	5,28 %	7,26 %	-14,72 %	4,96 %
	Klasse GE EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	4,66 %	6,63 %	-16,23 %	-1,15 %
	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09.05.2007	USD	6,04 %	7,36 %	-6,30 %
Klasse A USD, ausschüttend (D)		30.08.2002	USD	6,01 %	7,35 %	-6,30 %	19,19 %
Klasse A USD, ausschüttend (M)		19.02.2008	USD	6,04 %	7,36 %	-6,30 %	19,27 %
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		19.01.2017	USD	6,04 %	7,36 %	-6,30 %	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		19.01.2017	AUD	4,48 %	5,72 %	-8,93 %	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		12.02.2008	EUR	3,98 %	5,07 %	-11,13 %	0,74 %
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		28.04.2008	EUR	3,94 %	5,05 %	-11,15 %	0,71 %
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		02.04.2013	EUR	3,96 %	5,07 %	-11,15 %	0,67 %
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		29.05.2008	GBP	5,41 %	6,59 %	-7,90 %	10,59 %
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		07.09.2017	HKD	5,77 %	7,40 %	-5,60 %	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		26.05.2009	SGD	4,36 %	5,79 %	-7,88 %	14,70 %
Klasse B USD, ausschüttend (D)		24.02.2004	USD	5,74 %	7,09 %	-7,00 %	16,24 %
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	5,52 %	6,83 %	-7,69 %	13,49 %
Klasse C USD, ausschüttend (D)		24.02.2004	USD	5,49 %	6,82 %	-7,69 %	13,36 %

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24	
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)	Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	26.04.2018	ZAR	8,85 %	10,18 %	3,68 %	–	
	Klasse E USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	5,41 %	6,73 %	-7,97 %	12,34 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	5,38 %	6,71 %	-7,98 %	12,23 %	
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	19.05.2011	EUR	3,34 %	4,42 %	-12,71 %	-5,12 %	
	Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	02.08.2013	EUR	3,33 %	4,44 %	-12,71 %	-5,08 %	
	Klasse F USD, thesaurierend	04.02.2010	USD	6,69 %	8,01 %	-4,60 %	26,66 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	6,64 %	7,99 %	-4,60 %	26,54 %	
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	03.07.2013	USD	6,60 %	7,94 %	-4,77 %	25,87 %	
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	21.02.2023	EUR	4,61 %	–	–	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	27.06.2016	GBP	5,94 %	7,15 %	-6,44 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend							
	Klasse Premier US\$ Ausschüttend (M)	10.09.2008	USD	6,95 %	8,28 %	-3,88 %	29,86 %	
		06.02.2009	USD	6,96 %	8,28 %	-3,86 %	29,89 %	
	Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	01.12.2022	CHF	2,60 %	3,94 %	–	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	17.12.2009	EUR	4,84 %	5,93 %	-8,93 %	9,61 %	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	23.11.2012	EUR	4,86 %	5,98 %	-8,83 %	9,66 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	18.04.2008	GBP	6,33 %	7,51 %	-5,52 %	19,95 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	05.02.2013	GBP	6,33 %	7,52 %	-5,51 %	20,31 %	
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	08.10.2015	PLN	8,12 %	9,81 %	1,05 %	–	
	Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	03.12.2010	AUD	5,79 %	7,02 %	-5,51 %	34,93 %	
	Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	03.12.2010	GBP	6,77 %	7,94 %	-4,40 %	25,05 %	
	FTGF Western Asset US High Yield Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09.05.2007	USD	8,39 %	11,31 %	0,47 %	30,33 %
		Klasse A USD, ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	8,34 %	11,28 %	0,44 %	30,17 %
Klasse A USD, ausschüttend (M)		20.12.2010	USD	8,39 %	11,31 %	0,45 %	30,33 %	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		21.11.2012	USD	8,40 %	11,32 %	0,46 %	30,35 %	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		19.12.2012	EUR	6,23 %	8,93 %	-4,73 %	10,23 %	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		31.01.2013	SGD	6,71 %	9,71 %	-1,22 %	25,29 %	
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	7,85 %	10,76 %	-1,02 %	23,98 %	
Klasse C USD, ausschüttend (D)		27.02.2004	USD	7,79 %	10,74 %	-1,05 %	23,73 %	
Klasse E USD, thesaurierend		21.01.2010	USD	7,73 %	10,64 %	-1,34 %	22,72 %	
Klasse E USD, ausschüttend (D)		21.01.2010	USD	7,67 %	10,57 %	-1,39 %	22,45 %	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		25.09.2019	EUR	5,60 %	8,28 %	-6,38 %	–	
Klasse F USD, thesaurierend		04.01.2011	USD	8,82 %	11,76 %	1,92 %	37,91 %	
Klasse F USD, ausschüttend (D)		04.01.2011	USD	8,76 %	11,71 %	1,96 %	37,38 %	
Klasse Premier USD, thesaurierend		08.11.2010	USD	9,09 %	12,04 %	2,69 %	41,32 %	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		09.08.2019	GBP	8,42 %	11,31 %	1,06 %	–	
Klasse S USD, ausschüttend (M)		09.03.2022	USD	9,39 %	12,32 %	–	–	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		09.03.2022	EUR	7,12 %	9,81 %	–	–	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		27.05.2008	USD	9,60 %	12,54 %	4,11 %	47,87 %	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		12.06.2020	GBP	8,92 %	11,72 %	2,15 %	–	
Klasse A (G) USD, thesaurierend		20.04.2007	USD	8,33 %	11,25 %	0,56 %	31,76 %	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	8,29 %	11,24 %	0,55 %	31,57 %	
Klasse L (G) USD, thesaurierend		20.04.2007	USD	7,79 %	10,69 %	-0,94 %	25,34 %	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	7,75 %	10,70 %	-0,94 %	25,15 %	
Klasse GF USD, thesaurierend		19.11.2010	USD	8,55 %	11,48 %	1,17 %	34,45 %	
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	7,33 %	9,17 %	-6,38 %	17,78 %
		Klasse A USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	7,29 %	9,16 %	-6,36 %	17,83 %
		Klasse A USD, ausschüttend (M)	30.01.2008	USD	7,32 %	9,16 %	-6,39 %	17,69 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	21.11.2012	USD	7,32 %	9,15 %	-6,39 %	17,70 %	
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28.06.2010	AUD	5,68 %	7,45 %	-9,33 %	16,88 %	
	Klasse A EUR, thesaurierend	23.05.2017	EUR	5,04 %	5,86 %	3,57 %	–	
	Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	25.09.2012	EUR	5,23 %	6,85 %	-11,26 %	-0,56 %	
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	18.01.2011	SGD	5,67 %	7,49 %	-8,18 %	12,88 %	
	Klasse B USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	7,03 %	8,90 %	-7,04 %	14,89 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	6,79 %	8,63 %	-7,76 %	12,03 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	6,74 %	8,60 %	-7,78 %	12,05 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	6,55 %	8,42 %	-8,18 %	10,65 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	6,52 %	8,41 %	-8,17 %	10,65 %	
	Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	02.08.2013	EUR	4,43 %	6,06 %	-13,09 %	-6,60 %	
	Klasse F USD, thesaurierend	04.01.2011	USD	7,62 %	9,50 %	-5,03 %	25,28 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	04.01.2011	USD	7,58 %	9,47 %	-5,07 %	25,12 %	
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	21.03.2018	USD	7,69 %	9,59 %	-4,93 %	–	

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)	Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	15.01.2013	GBP	7,11 %	8,85 %	-6,72 %	15,04 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	12.10.2012	EUR	5,77 %	7,42 %	-9,38 %	8,37 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	12.08.2011	GBP	7,29 %	9,01 %	-6,09 %	18,09 %
	Klasse S USD, ausschüttend (M)	09.03.2022	USD	8,29 %	10,14 %	–	–
	LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	09.03.2022	EUR	6,07 %	7,67 %	–	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	7,03 %	8,90 %	-6,58 %	18,60 %
	Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	6,99 %	8,89 %	-6,60 %	18,60 %
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	6,50 %	8,35 %	-7,97 %	12,81 %
	Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	6,47 %	8,34 %	-7,96 %	12,90 %
	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Klasse A USD, thesaurierend	02.07.2008	USD	2,93 %	4,37 %	-9,26 %
Klasse A USD, ausschüttend (D)		02.07.2008	USD	2,96 %	4,41 %	-9,22 %	13,40 %
Klasse A USD, ausschüttend (M)		07.01.2010	USD	2,93 %	4,37 %	-9,26 %	13,49 %
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		21.11.2012	USD	2,92 %	4,37 %	-9,26 %	13,47 %
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		28.09.2011	AUD	1,43 %	2,76 %	-11,68 %	13,80 %
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)		26.01.2015	CHF	-1,18 %	0,23 %	-16,09 %	–
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus		20.06.2013	CNH	0,28 %	1,59 %	-9,45 %	29,42 %
Klasse A EUR, thesaurierend		02.07.2008	EUR	0,74 %	1,20 %	0,45 %	44,97 %
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		19.05.2011	EUR	0,96 %	2,21 %	-13,82 %	-4,44 %
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		01.04.2011	EUR	0,78 %	1,24 %	0,46 %	44,68 %
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		27.10.2015	HKD	2,67 %	4,39 %	-8,66 %	–
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		19.05.2009	SGD	1,30 %	2,89 %	-10,78 %	8,78 %
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		18.01.2011	SGD	1,24 %	2,74 %	-10,88 %	8,74 %
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		04.08.2010	SGD	2,62 %	2,70 %	-9,56 %	19,88 %
Klasse B USD, thesaurierend		02.07.2008	USD	2,67 %	4,11 %	-9,93 %	10,68 %
Klasse C USD, thesaurierend		02.07.2008	USD	2,41 %	3,85 %	-10,60 %	7,96 %
Klasse C USD, ausschüttend (D)		02.07.2008	USD	2,43 %	3,87 %	-10,59 %	7,86 %
Klasse E USD, thesaurierend		21.01.2010	USD	2,31 %	3,74 %	-10,88 %	6,89 %
Klasse E USD, ausschüttend (D)		21.01.2010	USD	2,33 %	3,78 %	-10,85 %	6,78 %
Klasse F USD, thesaurierend		04.02.2010	USD	3,35 %	4,79 %	-8,16 %	18,12 %
Klasse F USD, ausschüttend (D)		21.01.2010	USD	3,38 %	4,83 %	-8,11 %	18,16 %
Klasse X USD, ausschüttend (M)		07.05.2015	USD	3,45 %	4,88 %	-7,90 %	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		02.07.2008	USD	3,61 %	5,05 %	-7,48 %	21,11 %
Klasse Premier EUR, thesaurierend		03.09.2010	EUR	1,35 %	1,86 %	2,39 %	54,40 %
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		10.03.2011	EUR	1,59 %	2,85 %	-12,12 %	2,24 %
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		09.01.2013	EUR	1,39 %	1,86 %	2,38 %	54,47 %
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M)		08.09.2010	EUR	1,39 %	1,86 %	2,39 %	54,81 %
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)		16.07.2010	GBP	-1,31 %	-0,40 %	-0,66 %	61,16 %
Klasse LM USD, thesaurierend		12.06.2008	USD	4,23 %	5,68 %	-5,80 %	28,60 %
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		01.03.2022	USD	4,23 %	5,68 %	–	–
Klasse LM EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		27.07.2021	EUR	2,24 %	3,48 %	–	–
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		Klasse A USD, thesaurierend	25.06.2009	USD	4,93 %	6,03 %	-2,58 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	02.06.2009	USD	4,93 %	6,03 %	-2,58 %	9,37 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.01.2014	EUR	2,91 %	3,84 %	-7,41 %	-7,47 %
	Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	23.06.2020	SEK	2,86 %	3,86 %	-6,66 %	–
	Klasse A SEK, ausschüttend (M) (abgesichert)	23.06.2020	SEK	3,01 %	4,00 %	-5,95 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	25.06.2009	USD	4,42 %	5,51 %	-4,02 %	4,03 %
	Klasse C USD, ausschüttend (M)	25.06.2009	USD	4,41 %	5,51 %	-4,03 %	4,02 %
	Klasse E USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	4,30 %	5,40 %	-4,31 %	3,10 %
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	4,27 %	5,36 %	-4,35 %	2,96 %
	Klasse F USD, thesaurierend	04.02.2010	USD	5,36 %	6,46 %	-1,40 %	13,96 %
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	22.06.2020	USD	5,34 %	6,44 %	-1,42 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	17.06.2020	EUR	3,51 %	4,41 %	-6,05 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	02.06.2009	USD	5,62 %	6,72 %	-0,67 %	16,94 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	01.03.2019	EUR	3,60 %	4,49 %	-5,61 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	02.06.2009	GBP	5,02 %	5,96 %	-2,27 %	8,68 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	02.06.2009	GBP	5,06 %	6,02 %	-2,27 %	8,90 %
	Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	15.12.2017	USD	5,72 %	6,83 %	-0,35 %	–
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	15.10.2021	EUR	3,74 %	4,62 %	–	–
	Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	12.12.2017	EUR	3,77 %	4,67 %	-5,26 %	–
	Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	12.12.2017	GBP	5,15 %	6,10 %	-1,97 %	–

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Klasse A USD, ausschüttend (A)	05.03.2015	USD	4,81 %	7,58 %	-9,53 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	17.02.2015	USD	5,23 %	7,95 %	-8,93 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	03.12.2010	USD	5,38 %	8,11 %	-8,35 %	23,48 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	27.06.2014	EUR	3,24 %	5,75 %	-13,11 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	09.12.2021	GBP	4,89 %	7,50 %	–	–
	Klasse S USD, thesaurierend	09.03.2022	USD	5,52 %	8,27 %	–	–
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	09.03.2022	EUR	3,34 %	5,84 %	–	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	28.03.2019	USD	5,77 %	8,53 %	-7,25 %	–
	Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	17.10.2018	CAD	5,00 %	7,79 %	-8,26 %	–
	FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	15.11.2011	USD	4,16 %	6,62 %	-12,45 %
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		15.11.2011	EUR	2,08 %	4,30 %	-16,99 %	-0,62 %
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		03.11.2021	EUR	2,76 %	4,99 %	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		03.11.2021	GBP	4,17 %	6,49 %	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend		27.01.2011	USD	5,19 %	7,69 %	-9,62 %	32,24 %
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)		15.01.2021	EUR	3,10 %	5,35 %	–	–
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	29.11.2013	USD	7,17 %	13,11 %	-12,90 %	24,60 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	01.08.2014	USD	7,16 %	13,10 %	-12,90 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (S)	08.04.2014	USD	7,16 %	13,11 %	-12,90 %	–
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	16.10.2017	AUD	4,98 %	10,73 %	-16,14 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	27.02.2015	AUD	4,99 %	10,73 %	-16,17 %	–
	Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	CHF	2,40 %	8,11 %	-20,10 %	-1,95 %
	Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	19.09.2014	CNH	4,27 %	9,93 %	-13,20 %	–
	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	03.12.2014	CNH	4,24 %	9,90 %	-13,25 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	EUR	4,75 %	10,33 %	-17,93 %	4,37 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	07.04.2015	EUR	4,85 %	9,67 %	-3,63 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	15.03.2019	EUR	4,74 %	10,33 %	-17,95 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	07.04.2016	EUR	4,74 %	10,33 %	-17,93 %	–
	Klasse A GBP, thesaurierend	23.12.2014	GBP	2,11 %	7,28 %	-6,51 %	–
	Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	GBP	6,17 %	11,91 %	-15,03 %	12,68 %
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	18.08.2016	GBP	6,19 %	11,92 %	-15,07 %	–
	Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	15.05.2015	SEK	4,39 %	10,09 %	-17,77 %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	10.03.2014	SGD	5,11 %	11,14 %	-14,76 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	03.12.2014	SGD	5,26 %	11,19 %	-14,79 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	09.02.2022	SGD	6,88 %	11,44 %	–	–
	Klasse C USD, thesaurierend	05.05.2014	USD	6,62 %	12,54 %	-14,20 %	–
	Klasse C USD, ausschüttend (S)	15.07.2014	USD	6,62 %	12,54 %	-14,20 %	–
	Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	17.12.2019	JPY	17,93 %	21,52 %	18,95 %	–
	Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)	21.09.2017	NOK	4,55 %	10,26 %	-16,32 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend	13.05.2014	USD	6,52 %	12,43 %	-14,45 %	–
	Klasse E USD, ausschüttend (S)	28.07.2014	USD	6,51 %	12,43 %	-14,45 %	–
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	25.08.2014	EUR	4,11 %	9,66 %	-19,40 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	18.06.2014	USD	7,59 %	13,56 %	-11,85 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (S)	16.10.2014	USD	7,59 %	13,56 %	-11,85 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	05.03.2014	USD	7,70 %	13,67 %	-11,59 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	26.10.2015	USD	7,70 %	13,66 %	-11,59 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (S)	03.02.2015	USD	7,69 %	13,66 %	-11,59 %	–
	Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	05.03.2014	CHF	2,92 %	8,64 %	-18,87 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	29.07.2014	EUR	5,38 %	10,21 %	-2,02 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	EUR	5,26 %	10,88 %	-16,75 %	9,76 %
	Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	11.08.2016	EUR	5,24 %	10,86 %	-16,69 %	–
	Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	17.05.2016	EUR	5,26 %	10,89 %	-16,68 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	23.12.2014	GBP	2,61 %	7,80 %	-5,17 %	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – (Fortsetzung)	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	GBP	6,70 %	12,46 %		19,44 %
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus(e)	20.10.2015	GBP	6,72 %	12,49 %	-13,76 %	–
	Klasse X SGD thesaurierend (abgesichert)	10.03.2014	SGD	5,65 %	11,69 %	-13,54 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	29.11.2013	USD	7,86 %	13,86 %	-11,18 %	32,99 %
	Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	10.02.2015	USD	7,86 %	13,84 %	-11,20 %	–
	Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)	03.07.2017	AUD	5,65 %	11,45 %	-14,51 %	–
	Klasse Premier AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	24.07.2015	AUD	5,63 %	11,42 %	-14,57 %	–
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	22.12.2015	BRL	12,87 %	19,86 %	3,98 %	–
	Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	04.12.2014	CHF	3,07 %	8,82 %	-18,55 %	–
	Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	27.11.2015	CHF	3,07 %	8,82 %	-18,53 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	03.07.2014	EUR	5,64 %	10,49 %	-1,61 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	26.03.2014	EUR	5,42 %	11,04 %	-16,31 %	–
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	27.11.2015	EUR	5,41 %	11,06 %	-16,34 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	01.12.2014	GBP	6,86 %	12,63 %	-13,39 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	21.05.2014	GBP	6,89 %	12,65 %	-13,40 %	–
	Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	01.12.2016	JPY	1,39 %	7,18 %	-18,84 %	–
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	21.07.2017	PLN	8,48 %	14,85 %	-7,57 %	–
	Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	15.05.2015	SEK	5,08 %	10,83 %	-16,14 %	–
	Klasse S USD, thesaurierend	29.11.2013	USD	8,30 %	14,30 %	-10,11 %	38,41 %
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	29.11.2013	EUR	5,83 %	11,46 %	-15,32 %	16,03 %
	Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	09.08.2016	AUD	6,69 %	12,54 %	-11,96 %	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05.04.2016	EUR	6,61 %	11,49 %	1,28 %	–
	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	11.08.2016	USD	6,31 %	8,70 %	-4,22 %
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		16.12.2015	USD	6,31 %	8,69 %	-4,07 %	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		23.01.2017	EUR	4,17 %	6,31 %	-9,20 %	–
Klasse C USD, thesaurierend		09.08.2016	USD	6,19 %	8,56 %	-4,56 %	–
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)		22.02.2017	CHF	2,63 %	4,93 %	-9,87 %	–
Klasse S USD, thesaurierend		15.01.2021	USD	7,38 %	9,79 %	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		18.11.2019	EUR	5,23 %	7,40 %	-6,38 %	–
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)		20.11.2019	GBP	6,69 %	8,95 %	-3,09 %	–
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)		25.07.2019	EUR	5,67 %	7,84 %	-5,30 %	–
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		16.12.2015	GBP	7,12 %	9,37 %	-1,93 %	–
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)		28.02.2022	CAD	7,03 %	9,42 %	–	–
Klasse S CHF, ausschüttend (A)		26.11.2021	CHF	0,84 %	-0,14 %	–	–
Klasse S CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)		25.07.2022	CHF	2,95 %	5,26 %	–	–
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)	23.05.2018	EUR	3,97 %	4,37 %	-4,76 %
	Klasse D USD, thesaurierend	24.01.2018	USD	5,90 %	6,41 %	-0,07 %	–
	Klasse D USD, ausschüttend (M)	14.02.2018	USD	5,88 %	6,40 %	-0,09 %	–
	Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	30.05.2018	USD	5,88 %	6,40 %	-0,08 %	–
	Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	30.05.2018	CHF	2,37 %	2,81 %	-5,67 %	–
	Klasse M USD, ausschüttend (M)	28.11.2018	USD	6,54 %	7,04 %	1,73 %	–
	Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	31.01.2018	EUR	4,59 %	4,95 %	-3,06 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	04.05.2016	USD	6,69 %	7,20 %	2,18 %	–
	Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	13.12.2017	USD	6,68 %	7,19 %	2,18 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	04.05.2016	EUR	4,72 %	5,06 %	-2,74 %	–
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert)	27.12.2017	EUR	4,70 %	5,03 %	-2,69 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	13.01.2016	USD	7,33 %	7,84 %	4,04 %	–
FTGF Western Asset US Mortgage- Backed Securities Fund [^]	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	13.01.2016	USD	1,25 %	3,54 %	-11,92 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	15.06.2022	USD	2,13 %	4,45 %	–	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	13.01.2016	USD	2,45 %	4,76 %	-8,81 %	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	Klasse LM USD, ausschüttend (Q)	11.01.2021	USD	3,37 %	7,54 %	–	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09.05.2007	USD	0,38 %	4,03 %	-19,98 %	-14,85 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	06.12.2010	USD	0,37 %	4,04 %	-19,98 %	-14,87 %
	Klasse A USD, ausschüttend (S)	01.10.2003	USD	0,39 %	4,04 %	-19,97 %	-14,85 %
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28.07.2014	AUD	-1,50 %	2,03 %	-23,25 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	19.02.2013	EUR	-1,96 %	1,46 %	-24,94 %	-30,14 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	18.01.2008	EUR	0,01 %	2,88 %	-14,43 %	-6,19 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	07.06.2013	EUR	-1,91 %	1,47 %	-24,99 %	-30,16 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (S)	14.10.2016	EUR	-1,80 %	0,84 %	-11,50 %	–
	Klasse A GBP, thesaurierend	22.06.2018	GBP	-4,34 %	-1,32 %	-14,14 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	14.11.2014	GBP	-0,49 %	2,99 %	-22,43 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	07.02.2008	GBP	1,30 %	4,27 %	-11,44 %	1,44 %
	Klasse A SGD, thesaurierend	08.06.2015	SGD	0,12 %	2,37 %	-20,39 %	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	0,14 %	3,79 %	-20,56 %	-16,94 %
	Klasse B USD, ausschüttend (S)	24.02.2004	USD	0,12 %	3,77 %	-20,58 %	-16,99 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-0,13 %	3,52 %	-21,17 %	-19,01 %
	Klasse C USD, ausschüttend (S)	24.02.2004	USD	-0,13 %	3,52 %	-21,17 %	-19,01 %
	Klasse E USD, thesaurierend	08.09.2011	USD	-0,22 %	3,42 %	-21,40 %	-19,82 %
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	13.07.2012	EUR	-0,59 %	2,26 %	-15,96 %	-11,55 %
	Klasse F USD, thesaurierend	14.09.2012	USD	0,78 %	4,46 %	-19,00 %	-11,39 %
	Klasse F USD, ausschüttend (S)	04.10.2012	USD	0,77 %	4,46 %	-19,00 %	-11,38 %
	Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	02.05.2013	GBP	1,70 %	4,67 %	-10,32 %	5,73 %
	Klasse X USD, thesaurierend	04.06.2013	USD	0,89 %	4,56 %	-18,77 %	-10,48 %
	Klasse X USD, ausschüttend (S)	26.03.2013	USD	0,88 %	4,56 %	-18,77 %	-10,50 %
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	28.06.2013	EUR	-1,42 %	1,97 %	-23,80 %	-26,57 %
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	19.08.2015	EUR	0,48 %	3,36 %	-13,17 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	23.12.2014	GBP	-3,89 %	-0,86 %	-12,96 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	10.10.2014	GBP	-0,12 %	3,38 %	-21,46 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	19.08.2015	GBP	1,85 %	4,84 %	-10,16 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	25.02.2013	GBP	-0,09 %	3,46 %	-21,35 %	-20,16 %
	Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	15.07.2014	GBP	1,82 %	4,81 %	-10,08 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	24.03.2011	USD	1,04 %	4,71 %	-18,40 %	-9,14 %
	Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	24.02.2012	USD	1,03 %	4,70 %	-18,41 %	-9,13 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	25.01.2011	EUR	-1,14 %	1,52 %	-9,73 %	15,25 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.01.2013	EUR	-1,32 %	2,13 %	-23,45 %	-25,57 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	04.11.2011	EUR	0,70 %	3,58 %	-12,73 %	0,24 %
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	15.09.2021	GBP	0,01 %	3,57 %	–	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	10.10.2014	GBP	0,08 %	3,56 %	-20,98 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	14.08.2012	GBP	1,96 %	4,94 %	-9,70 %	8,12 %
	Klasse LM USD, thesaurierend	28.03.2019	USD	1,64 %	5,35 %	-16,92 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	25.11.2015	USD	3,44 %	6,57 %	-6,18 %	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	03.04.2012	USD	1,71 %	2,37 %	-4,03 %	8,75 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	17.09.2013	USD	1,72 %	2,38 %	-4,03 %	8,82 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	18.06.2013	EUR	-0,53 %	-0,11 %	-9,38 %	-8,73 %
	Klasse A SGD, thesaurierend	17.05.2022	SGD	1,34 %	0,82 %	–	–
	Klasse C USD, thesaurierend	17.07.2013	USD	1,21 %	1,87 %	-5,45 %	3,42 %
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	27.08.2013	USD	1,10 %	1,77 %	-5,70 %	2,42 %
	Klasse F USD, thesaurierend	29.07.2014	USD	2,11 %	2,78 %	-2,88 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	16.03.2018	USD	2,19 %	2,83 %	-2,73 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	16.06.2014	GBP	1,32 %	1,78 %	-4,87 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	21.01.2014	GBP	1,26 %	1,72 %	-4,93 %	4,08 %
	Klasse Premier USD, thesaurierend	25.03.2013	USD	2,33 %	2,99 %	-2,28 %	15,45 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	02.07.2012	EUR	0,02 %	0,47 %	-7,71 %	-2,93 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	25.03.2013	GBP	1,40 %	1,92 %	-4,44 %	5,64 %
	Klasse LM USD, thesaurierend	12.06.2014	USD	3,26 %	3,92 %	0,38 %	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	14.10.2016	USD	12,46 %	13,99 %	1,42 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	18.07.2016	USD	12,56 %	14,09 %	1,51 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	30.11.2012	USD	13,22 %	14,75 %	3,61 %	43,80 %
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	30.11.2012	GBP	12,37 %	13,58 %	4,59 %	42,04 %
	Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	23.02.2016	CAD	12,50 %	13,89 %	5,74 %	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	06.05.2011	USD	2,20 %	6,47 %	-17,83 %	-4,90 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	25.06.2010	USD	2,19 %	6,46 %	-17,83 %	-4,92 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	04.04.2018	EUR	0,08 %	3,97 %	-22,69 %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend	17.04.2020	SGD	1,61 %	4,59 %	-18,50 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	21.03.2012	USD	1,69 %	5,93 %	-19,05 %	-9,55 %
	Klasse E USD, thesaurierend	17.02.2012	USD	1,58 %	5,83 %	-19,30 %	-10,46 %
	Klasse F USD, thesaurierend	22.07.2014	USD	2,61 %	6,89 %	-16,84 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (M)	19.07.2013	USD	2,59 %	6,89 %	-16,84 %	-1,09 %
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	10.10.2014	GBP	1,50 %	5,58 %	-19,55 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	27.05.2020	GBP	3,59 %	7,20 %	-7,83 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	06.01.2012	USD	2,87 %	7,16 %	-16,21 %	1,45 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	24.06.2016	GBP	3,77 %	7,38 %	-7,41 %	–
	Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	19.09.2012	NZD	3,95 %	7,56 %	-6,73 %	36,83 %
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05.04.2016	EUR	1,27 %	4,53 %	-5,52 %	–
	Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	13.01.2012	NZD	4,58 %	8,21 %	-5,00 %	45,81 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Klasse A USD, thesaurierend	30.08.2013	USD	5,82 %	7,22 %	-8,20 %	28,86 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	26.08.2020	USD	5,83 %	7,21 %	-8,21 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	28.08.2020	USD	5,80 %	7,22 %	-8,16 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	15.01.2021	USD	5,82 %	7,22 %	–	–
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	03.06.2013	USD	5,82 %	7,22 %	-8,21 %	28,79 %
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	23.06.2021	AUD	4,22 %	5,42 %	–	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30.08.2021	AUD	4,28 %	5,42 %	–	–
	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	15.04.2021	CNH	3,05 %	4,30 %	–	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	25.11.2020	EUR	3,60 %	4,01 %	1,76 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	22.08.2016	EUR	3,66 %	4,75 %	-13,37 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	19.05.2015	EUR	3,66 %	4,76 %	-13,42 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30.08.2021	EUR	3,64 %	4,78 %	–	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	21.10.2013	EUR	3,64 %	4,79 %	-13,37 %	7,95 %
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30.08.2021	GBP	5,08 %	6,34 %	–	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	24.10.2013	GBP	5,10 %	6,36 %	-10,39 %	18,22 %
	Klasse A HKD, thesaurierend	30.08.2021	HKD	5,54 %	7,24 %	–	–
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	09.04.2021	HKD	5,54 %	7,24 %	–	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	21.10.2015	SGD	4,07 %	5,60 %	-9,98 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17.02.2021	SGD	4,12 %	5,54 %	–	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	29.01.2021	SGD	5,64 %	5,54 %	–	–
	Klasse C USD, thesaurierend	23.09.2020	USD	5,29 %	6,69 %	-9,57 %	–
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24.11.2020	USD	5,28 %	6,68 %	-9,52 %	–
	Klasse A CZK, thesaurierend (abgesichert)	20.05.2022	CZK	7,02 %	8,45 %	–	–
	Klasse E USD, thesaurierend	21.04.2020	USD	5,19 %	6,58 %	-9,84 %	–
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	22.01.2021	USD	5,17 %	6,59 %	–	–
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	03.04.2017	EUR	3,02 %	4,11 %	-14,95 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	22.10.2020	USD	6,30 %	7,69 %	-6,96 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	24.07.2019	USD	6,27 %	7,70 %	-6,90 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	25.09.2020	USD	6,51 %	7,91 %	-6,58 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	18.07.2017	USD	6,72 %	8,09 %	-6,74 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	21.01.2014	USD	6,52 %	7,92 %	-6,58 %	36,55 %
	Klasse X EUR, thesaurierend	17.02.2021	EUR	4,19 %	4,63 %	–	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	16.02.2021	EUR	4,34 %	5,42 %	–	–
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	23.12.2013	EUR	4,31 %	5,45 %	-11,86 %	14,29 %	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	20.12.2013	GBP	5,79 %	7,07 %	-8,79 %	25,16 %	
Klasse Premier USD, thesaurierend	09.10.2020	USD	6,67 %	8,07 %	-6,16 %	–	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	03.06.2013	USD	6,67 %	8,09 %	-6,16 %	38,58 %	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24	
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	10.09.2021	BRL	12,01 %	14,11 %	–	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	07.10.2014	EUR	4,50 %	5,59 %	-11,43 %	–	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	13.12.2013	EUR	4,45 %	5,58 %	-11,44 %	16,06 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	23.10.2014	GBP	5,94 %	7,18 %	-8,35 %	–	
	Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	22.10.2014	SEK	4,45 %	5,63 %	-11,14 %	–	
	Klasse S USD, thesaurierend	06.07.2020	USD	6,78 %	8,18 %	-5,71 %	–	
	Klasse S USD, ausschüttend (Q) Plus (e)	14.09.2021	USD	6,77 %	8,18 %	–	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	10.04.2018	EUR	4,59 %	5,68 %	-11,04 %	–	
	Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	18.09.2018	EUR	4,59 %	5,74 %	-11,00 %	–	
	Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	01.02.2018	GBP	6,06 %	7,29 %	-8,01 %	–	
	Klasse LM USD, thesaurierend	06.07.2022	USD	7,16 %	8,56 %	–	–	
	Klasse LM USD, ausschüttend (M)	30.09.2021	USD	7,16 %	8,55 %	–	–	
	Klasse LM EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	11.08.2021	EUR	4,98 %	6,08 %	–	–	
	Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	08.10.2020	GBP	6,46 %	7,71 %	-6,97 %	–	
	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	30.06.2014	USD	0,95 %	-1,68 %	0,91 %	–
		Klasse X USD, ausschüttend (M)	30.04.2021	USD	1,52 %	-1,12 %	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		30.06.2014	USD	1,61 %	-1,05 %	2,89 %	–	
Klasse LM USD, thesaurierend		30.06.2014	USD	2,79 %	0,09 %	6,50 %	–	
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	16.08.2018	USD	5,89 %	9,71 %	-11,72 %	–	
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	16.09.2019	SGD	3,94 %	7,83 %	-14,13 %	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	16.08.2018	GBP	5,77 %	9,40 %	-12,72 %	–	
	Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	16.08.2018	AUD	5,95 %	9,65 %	-10,52 %	–	
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	01.12.2022	USD	5,95 %	7,59 %	–	–	
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	Klasse S USD, thesaurierend	01.12.2022	USD	6,96 %	8,60 %	–	–	
	Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	01.12.2022	EUR	4,93 %	6,26 %	–	–	
	Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	17.01.2023	GBP	6,21 %	–	–	–	
	Klasse A USD, thesaurierend	24.04.2007	USD	14,08 %	16,72 %	35,15 %	116,47 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	23.03.1998	USD	14,09 %	16,71 %	35,14 %	116,47 %	
FTGF ClearBridge Value Fund	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	12.06.2007	EUR	11,68 %	13,20 %	49,42 %	175,52 %	
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	02.09.2022	EUR	11,61 %	13,94 %	–	–	
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	02.09.2014	EUR	11,67 %	13,98 %	25,89 %	–	
	Klasse A GBP ausschüttend (A)	28.08.2014	GBP	8,71 %	10,70 %	44,41 %	–	
	Klasse A SGD, thesaurierend	18.05.2007	SGD	13,86 %	15,00 %	34,80 %	129,25 %	
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	10.09.2012	SGD	12,14 %	14,90 %	31,41 %	103,19 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	13,52 %	16,14 %	33,13 %	105,92 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	13,52 %	16,13 %	33,14 %	105,92 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	26.03.2021	USD	13,23 %	15,85 %	–	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	14,78 %	17,41 %	37,59 %	130,94 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (A)	19.10.2016	USD	14,78 %	17,40 %	37,58 %	–	
	Klasse X USD, thesaurierend	08.03.2022	USD	14,85 %	17,49 %	–	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	07.10.2013	USD	14,86 %	17,50 %	37,91 %	131,71 %	
	Klasse X EUR, thesaurierend	22.02.2021	EUR	12,35 %	13,89 %	–	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	01.07.2008	USD	15,26 %	17,91 %	39,36 %	139,83 %	
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	25.04.2014	USD	15,26 %	17,91 %	39,35 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	30.06.2014	EUR	12,77 %	14,30 %	54,17 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	08.04.2021	EUR	12,90 %	15,25 %	–	–	
	LM Klasse USD, ausschüttend (A)	21.07.2021	USD	16,05 %	18,71 %	–	–	
	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	28,56 %	18,91 %	21,57 %	153,17 %
Klasse A USD, ausschüttend (A)		20.04.2007	USD	28,56 %	18,91 %	21,57 %	153,19 %	
Klasse A EUR, thesaurierend		03.06.2008	EUR	25,81 %	15,28 %	34,53 %	223,35 %	
Klasse B USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	27,92 %	18,32 %	19,77 %	140,94 %	
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	27,91 %	18,32 %	19,77 %	140,81 %	
Klasse C USD, ausschüttend (A)		20.04.2007	USD	27,92 %	18,31 %	19,77 %	140,81 %	
Klasse E USD, thesaurierend		21.01.2010	USD	27,59 %	18,01 %	18,87 %	134,83 %	
Klasse E USD, ausschüttend (A)		21.01.2010	USD	27,58 %	18,01 %	18,84 %	134,78 %	
Klasse F USD, thesaurierend		17.09.2012	USD	29,32 %	19,60 %	23,74 %	168,69 %	
Klasse F USD, ausschüttend (A)		04.02.2010	USD	29,32 %	19,60 %	23,74 %	168,68 %	
Klasse X USD, ausschüttend (A)		07.10.2013	USD	29,36 %	19,63 %	23,84 %	169,35 %	
Klasse X EUR, thesaurierend		07.10.2013	EUR	26,59 %	16,00 %	37,05 %	244,71 %	
Klasse Premier USD, thesaurierend		06.05.2010	USD	29,81 %	20,05 %	25,14 %	179,00 %	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24	
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	09.04.2009	USD	29,81 %	20,05 %	25,14 %	178,94 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	07.06.2010	EUR	27,09 %	16,48 %	38,67 %	256,57 %	
	Klasse LM USD, thesaurierend	05.04.2016	USD	30,62 %	20,80 %	27,50 %	–	
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05.04.2016	EUR	27,80 %	17,10 %	41,08 %	–	
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	29,00 %	19,31 %	22,82 %	162,07 %	
	Klasse B (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	28,33 %	18,68 %	20,85 %	148,76 %	
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	28,36 %	18,71 %	21,00 %	149,29 %	
	Klasse GA USD, thesaurierend	10.06.2011	USD	28,78 %	19,10 %	22,20 %	157,64 %	
	Klasse GA EUR, thesaurierend	10.06.2011	EUR	26,05 %	15,51 %	35,25 %	229,35 %	
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	10.06.2011	EUR	26,03 %	15,49 %	35,25 %	229,07 %	
	Klasse GE USD, thesaurierend	10.06.2011	USD	27,82 %	18,22 %	19,48 %	139,04 %	
	Klasse GE EUR, thesaurierend	10.06.2011	EUR	25,11 %	14,66 %	32,23 %	205,94 %	
	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	46,86 %	42,52 %	15,54 %	239,87 %
		Klasse A USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	46,86 %	42,52 %	15,54 %	239,92 %
Klasse A EUR, thesaurierend		27.08.2008	EUR	43,71 %	38,19 %	27,83 %	332,88 %	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		05.02.2016	EUR	43,98 %	39,42 %	7,95 %	–	
Klasse B USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	46,13 %	41,82 %	13,82 %	223,27 %	
Klasse B USD, ausschüttend (A)		20.04.2007	USD	46,12 %	41,81 %	13,83 %	223,30 %	
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	46,13 %	41,82 %	13,83 %	223,30 %	
Klasse C USD, ausschüttend (A)		20.04.2007	USD	46,12 %	41,82 %	13,83 %	223,30 %	
Klasse E USD, thesaurierend		14.01.2016	USD	45,76 %	41,46 %	12,98 %	–	
Klasse E USD, ausschüttend (A)		13.10.2015	USD	45,77 %	41,47 %	12,98 %	–	
Klasse F USD, thesaurierend		19.04.2016	USD	47,74 %	43,37 %	17,64 %	–	
Klasse F USD, ausschüttend (A)		04.11.2015	USD	47,74 %	43,37 %	17,64 %	–	
Klasse U USD, thesaurierend		02.03.2018	USD	48,45 %	44,05 %	19,32 %	–	
Klasse U EUR, thesaurierend		02.03.2018	EUR	45,32 %	39,71 %	32,02 %	–	
Klasse X USD, thesaurierend		29.09.2015	USD	47,78 %	43,41 %	17,73 %	–	
Klasse X EUR, thesaurierend		17.01.2018	EUR	44,69 %	39,17 %	30,08 %	–	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		27.07.2016	EUR	44,94 %	40,34 %	9,85 %	–	
Klasse X GBP, thesaurierend		04.12.2015	GBP	40,76 %	35,97 %	26,33 %	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend		19.09.2014	USD	48,30 %	43,92 %	18,96 %	–	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		21.02.2020	USD	48,30 %	43,91 %	18,97 %	–	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		15.02.2018	BRL	55,45 %	51,45 %	37,25 %	–	
Klasse Premier EUR, thesaurierend		15.09.2016	EUR	45,14 %	39,55 %	31,58 %	–	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		02.03.2016	EUR	45,46 %	40,83 %	11,08 %	–	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		21.02.2020	EUR	45,12 %	39,56 %	31,62 %	–	
Klasse Premier GBP, thesaurierend		02.12.2015	GBP	41,30 %	36,48 %	27,59 %	–	
Klasse LM USD, thesaurierend		05.04.2016	USD	49,22 %	44,82 %	21,22 %	–	
Klasse LM EUR, thesaurierend		05.04.2016	EUR	46,14 %	40,48 %	34,25 %	–	
Klasse A (G) USD, thesaurierend		20.04.2007	USD	47,37 %	43,02 %	16,76 %	251,92 %	
Klasse L (G) USD, thesaurierend		20.04.2007	USD	46,64 %	42,31 %	15,03 %	234,76 %	
Klasse GA USD, thesaurierend		27.08.2010	USD	47,12 %	42,78 %	16,17 %	245,98 %	
Klasse GA EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	43,98 %	38,46 %	28,57 %	341,96 %		
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	23,34 %	25,80 %	-4,25 %	54,68 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	23,33 %	25,80 %	-4,24 %	54,74 %	
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	03.06.2013	AUD	20,90 %	22,91 %	-10,07 %	42,51 %	
	Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	23.10.2014	CHF	18,19 %	20,44 %	-12,68 %	–	
	Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	14.11.2014	CNH	20,09 %	22,22 %	-5,44 %	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend	07.09.2010	EUR	20,69 %	21,97 %	5,96 %	96,87 %	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	02.04.2013	EUR	20,81 %	22,87 %	-10,68 %	28,66 %	
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	28.08.2014	EUR	20,81 %	22,87 %	-10,68 %	–	
	Klasse A GBP, thesaurierend	29.09.2014	GBP	17,54 %	19,34 %	2,76 %	–	
	Klasse A HKD, thesaurierend	27.10.2015	HKD	22,99 %	25,81 %	-3,61 %	–	
	Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	31.01.2013	SEK	20,44 %	22,64 %	-11,27 %	23,55 %	
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	31.01.2013	SGD	21,18 %	23,70 %	-7,00 %	44,78 %	
	Klasse B USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	22,72 %	25,17 %	-5,66 %	47,15 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	22,72 %	25,17 %	-5,67 %	47,14 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	22,72 %	25,18 %	-5,67 %	47,14 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	04.01.2011	USD	22,42 %	24,86 %	-6,37 %	43,51 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	22,41 %	24,86 %	-6,37 %	43,51 %	
	Klasse E EUR, thesaurierend	16.03.2021	EUR	19,78 %	21,06 %	–	–	
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	10.09.2013	EUR	19,88 %	21,94 %	-12,71 %	19,69 %	
	Klasse F USD, thesaurierend	04.01.2011	USD	24,07 %	26,55 %	-2,51 %	64,23 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	24,07 %	26,55 %	-2,51 %	64,24 %	
	Klasse X USD, thesaurierend	17.05.2013	USD	24,14 %	26,61 %	-2,36 %	65,06 %	
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	13.02.2013	USD	24,14 %	26,61 %	-2,37 %	65,06 %	
	Klasse X EUR, thesaurierend	21.01.2014	EUR	21,50 %	22,78 %	8,05 %	110,95 %	
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	19.02.2014	EUR	21,50 %	23,57 %	-9,03 %	37,31 %	
	Klasse X GBP, thesaurierend	24.04.2013	GBP	20,08 %	20,08 %	4,72 %	117,74 %	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	17.03.2010	USD	24,57 %	27,06 %	-1,34 %	70,92 %	

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24	
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier EUR, thesaurierend	14.12.2010	EUR	21,90 %	23,22 %	9,20 %	117,44 %	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	27.02.2017	GBP	18,71 %	20,51 %	5,79 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	22.04.2014	GBP	23,64 %	25,84 %	-5,24 %	–	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	13.12.2012	GBP	18,69 %	20,49 %	5,82 %	126,41 %	
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05.04.2016	EUR	22,70 %	23,99 %	11,32 %	–	
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	23,77 %	26,24 %	-3,24 %	60,18 %	
	Klasse B (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	23,18 %	25,64 %	-4,65 %	52,49 %	
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	23,15 %	25,61 %	-4,67 %	52,38 %	
	Klasse GA EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	20,98 %	22,26 %	6,70 %	101,94 %	
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	27.08.2010	EUR	20,98 %	22,26 %	6,70 %	101,94 %	
	Klasse GE USD, thesaurierend	27.08.2010	USD	22,69 %	25,15 %	-5,72 %	46,85 %	
	Klasse GE EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	20,07 %	21,35 %	4,32 %	87,54 %	
	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	13.08.2013	USD	15,65 %	13,76 %	17,77 %	46,86 %
		Klasse A USD, ausschüttend (A)	27.03.2015	USD	15,65 %	13,76 %	17,77 %	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		19.06.2014	USD	15,66 %	13,76 %	17,77 %	–	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		03.06.2013	USD	15,61 %	13,74 %	17,75 %	46,85 %	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)		08.05.2015	USD	15,65 %	13,75 %	17,76 %	–	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		25.06.2014	AUD	13,59 %	11,42 %	11,57 %	–	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus		28.07.2014	CNH	12,61 %	10,56 %	16,70 %	–	
Klasse A EUR, thesaurierend		27.03.2015	EUR	13,18 %	10,31 %	30,32 %	–	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		21.11.2014	EUR	13,25 %	11,04 %	10,22 %	–	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		27.02.2014	EUR	13,23 %	11,02 %	10,25 %	22,55 %	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		28.07.2014	HKD	15,35 %	13,75 %	18,49 %	–	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		28.07.2014	SGD	13,68 %	11,86 %	14,74 %	–	
Klasse C USD, thesaurierend		27.09.2013	USD	15,08 %	13,19 %	16,02 %	39,70 %	
Klasse C USD, ausschüttend (A)		27.03.2015	USD	15,08 %	13,19 %	16,02 %	–	
Klasse C USD, ausschüttend (Q)		29.08.2014	USD	15,08 %	13,20 %	16,03 %	–	
Klasse F USD, thesaurierend		27.03.2015	USD	16,35 %	14,43 %	19,90 %	–	
Klasse F EUR, thesaurierend		27.03.2015	EUR	13,86 %	10,96 %	32,68 %	–	
Klasse F EUR, ausschüttend (A)		27.03.2015	EUR	13,88 %	10,98 %	32,69 %	–	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		24.04.2017	EUR	13,98 %	11,76 %	12,28 %	–	
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Klasse A USD, thesaurierend	11.03.2020	USD	16,25 %	15,16 %	9,76 %	–	
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	16,25 %	15,16 %	9,76 %	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend	28.02.2022	EUR	13,74 %	11,67 %	–	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.09.2015	EUR	13,87 %	12,54 %	2,49 %	–	
	Klasse A SEK, thesaurierend	21.01.2020	SEK	15,31 %	11,48 %	35,12 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	11.03.2020	USD	16,95 %	15,86 %	11,75 %	–	
	Klasse X USD, thesaurierend	30.07.2020	USD	16,94 %	15,86 %	11,76 %	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	16,95 %	15,85 %	11,75 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	24.03.2021	EUR	14,47 %	12,43 %	–	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.09.2015	EUR	14,58 %	13,20 %	4,45 %	–	
	Klasse X GBP, thesaurierend	22.12.2015	GBP	11,39 %	9,84 %	19,64 %	–	
	Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	18.12.2019	GBP	16,17 %	14,89 %	7,78 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	24.06.2020	USD	17,36 %	16,26 %	12,93 %	–	
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	17,36 %	16,26 %	12,93 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	27.05.2022	EUR	14,91 %	12,77 %	–	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.09.2015	EUR	14,95 %	13,61 %	5,63 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	30.09.2015	GBP	11,78 %	10,21 %	21,12 %	–	
	Klasse S USD, thesaurierend	11.07.2018	USD	17,60 %	16,49 %	13,60 %	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend	13.07.2020	EUR	15,06 %	12,93 %	24,92 %	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	13.07.2020	EUR	15,14 %	13,76 %	6,25 %	–	
Klasse S GBP, thesaurierend	31.07.2019	GBP	12,03 %	10,48 %	21,67 %	–		
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	19.11.2019	GBP	16,71 %	15,46 %	9,52 %	–		
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	31.07.2019	GBP	12,05 %	10,48 %	21,77 %	–		
Klasse LM EUR, thesaurierend	21.05.2021	EUR	15,53 %	13,41 %	–	–		
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	29.06.2018	USD	25,56 %	21,46 %	3,36 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	29.06.2018	USD	26,83 %	22,67 %	6,49 %	–	
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	10.11.2017	USD	4,86 %	5,59 %	10,24 %	–	
	Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	16.03.2017	USD	4,24 %	4,24 %	27,94 %	–	
	Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	19.06.2017	USD	4,15 %	4,13 %	27,81 %	–	
	Klasse A USD, ausschüttend (Q)	12.12.2016	USD	4,81 %	5,55 %	10,53 %	–	
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	24.10.2019	AUD	2,76 %	2,54 %	23,20 %	–	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24	
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – (Fortsetzung)	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	24.10.2019	CNH	1,60 %	1,52 %	27,64 %	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend	12.12.2016	EUR	2,59 %	2,37 %	22,40 %	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	03.12.2019	EUR	3,06 %	3,03 %	13,09 %	–	
	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	26.04.2022	EUR	2,58 %	2,36 %	–	–	
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	22.10.2018	EUR	2,56 %	2,42 %	22,43 %	–	
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	05.06.2017	SGD	2,67 %	2,68 %	25,59 %	–	
	Klasse C USD, thesaurierend	26.09.2017	USD	4,30 %	5,15 %	8,73 %	–	
	Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	26.09.2017	USD	3,64 %	3,64 %	25,83 %	–	
	Klasse E USD, thesaurierend	12.12.2016	USD	4,06 %	4,86 %	8,15 %	–	
	Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	12.04.2021	USD	3,49 %	3,49 %	–	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	10.08.2017	USD	5,55 %	6,34 %	12,49 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	26.09.2017	USD	4,82 %	4,82 %	30,08 %	–	
	Klasse X USD, thesaurierend	20.03.2019	USD	5,75 %	6,47 %	13,45 %	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	17.05.2017	USD	5,78 %	6,52 %	13,70 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	24.10.2018	EUR	3,56 %	3,34 %	25,75 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	05.03.2021	EUR	4,03 %	4,08 %	–	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	30.05.2019	GBP	0,77 %	1,02 %	21,69 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	04.02.2014	USD	6,05 %	6,76 %	14,20 %	60,08 %	
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	15.02.2018	BRL	10,65 %	11,27 %	55,44 %	–	
	Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	16.06.2017	CAD	5,35 %	5,51 %	20,67 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	11.05.2012	EUR	3,73 %	3,51 %	26,56 %	104,34 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	17.04.2019	EUR	4,11 %	4,15 %	16,52 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	30.06.2016	GBP	0,96 %	1,19 %	22,62 %	–	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	25.06.2009	GBP	5,53 %	5,55 %	19,46 %	73,83 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	26.04.2018	GBP	0,95 %	1,24 %	22,53 %	–	
	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	16.06.2021	USD	-0,79 %	1,96 %	–	–
		Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	30.04.2021	USD	-0,79 %	1,96 %	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		30.04.2021	USD	-0,80 %	1,97 %	–	–	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		12.08.2021	AUD	-2,92 %	-0,36 %	–	–	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus		01.10.2021	CNH	-3,59 %	-0,98 %	–	–	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)		11.08.2022	EUR	-2,88 %	-1,09 %	–	–	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		11.08.2021	EUR	-2,99 %	-0,49 %	–	–	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		23.11.2021	GBP	-1,59 %	0,91 %	–	–	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		01.07.2021	HKD	-1,05 %	2,02 %	–	–	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		16.06.2021	SGD	-2,66 %	0,15 %	–	–	
Klasse U USD, thesaurierend		27.01.2023	USD	0,46 %	–	–	–	
Klasse U EUR, thesaurierend		25.01.2023	EUR	-1,77 %	–	–	–	
Klasse A GBP, thesaurierend		26.01.2023	GBP	-4,22 %	–	–	–	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		30.04.2021	USD	-0,04 %	2,74 %	–	–	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		26.04.2022	EUR	-2,28 %	0,24 %	–	–	
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)		30.04.2021	EUR	-2,36 %	0,16 %	–	–	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)		12.01.2022	GBP	-0,99 %	1,59 %	–	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend		27.05.2022	USD	0,31 %	3,09 %	–	–	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus		09.06.2021	USD	0,31 %	3,09 %	–	–	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		24.06.2021	EUR	-1,91 %	0,64 %	–	–	
Klasse S USD, thesaurierend		17.06.2021	USD	0,66 %	3,45 %	–	–	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus		06.07.2021	USD	0,65 %	3,45 %	–	–	
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		Klasse A USD, thesaurierend	09.05.2007	USD	7,42 %	18,23 %	25,01 %	102,49 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	08.11.2002	USD	7,42 %	18,24 %	25,01 %	102,47 %	
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	03.06.2013	AUD	4,98 %	15,55 %	16,91 %	82,28 %	
	Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	05.12.2016	CNH	4,55 %	14,94 %	23,50 %	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend	12.07.2007	EUR	5,10 %	14,62 %	38,19 %	157,95 %	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	20.02.2013	EUR	4,99 %	15,40 %	16,50 %	67,35 %	
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	16.11.2016	EUR	5,02 %	15,40 %	16,10 %	–	
	Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	20.12.2013	GBP	6,49 %	17,07 %	19,72 %	75,38 %	
	Klasse A GBP ausschüttend (A)	26.04.2011	GBP	2,35 %	12,12 %	34,08 %	168,90 %	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24	
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)	Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	31.01.2013	SEK	4,63 %	15,32 %	15,51 %	58,79 %	
	Klasse A SGD, thesaurierend	16.02.2011	SGD	7,06 %	16,34 %	24,46 %	113,59 %	
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	10.09.2012	SGD	5,37 %	16,15 %	21,24 %	88,14 %	
	Klasse B USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	6,89 %	17,66 %	23,17 %	92,61 %	
	Klasse B USD, ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	6,87 %	17,64 %	23,13 %	92,43 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	6,88 %	17,65 %	23,16 %	92,61 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	6,88 %	17,65 %	23,16 %	92,63 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	04.01.2011	USD	6,61 %	17,35 %	22,23 %	87,85 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	6,61 %	17,35 %	22,24 %	87,85 %	
	Klasse E EUR, thesaurierend	26.11.2010	EUR	4,32 %	13,82 %	35,08 %	139,88 %	
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	23.09.2013	EUR	4,24 %	14,58 %	13,98 %	55,19 %	
	Klasse F USD, thesaurierend	04.01.2011	USD	8,07 %	18,94 %	27,28 %	115,00 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	8,07 %	18,94 %	27,28 %	115,00 %	
	Klasse R EUR, thesaurierend	09.12.2013	EUR	5,65 %	15,22 %	40,66 %	172,34 %	
	Klasse X USD, thesaurierend	25.02.2013	USD	8,23 %	19,12 %	27,85 %	118,25 %	
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	28.11.2016	USD	8,23 %	19,12 %	27,85 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	11.10.2017	EUR	5,97 %	15,55 %	41,42 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	21.10.2013	EUR	5,83 %	16,23 %	19,09 %	80,11 %	
	Klasse X GBP, thesaurierend	18.01.2013	GBP	3,12 %	12,97 %	37,10 %	188,98 %	
	Klasse X GBP ausschüttend (A)	23.04.2013	GBP	3,12 %	12,98 %	37,08 %	188,21 %	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	27.04.2010	USD	8,61 %	19,54 %	29,20 %	126,01 %	
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	15.02.2018	BRL	13,59 %	25,54 %	47,98 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	07.06.2010	EUR	6,28 %	15,92 %	42,85 %	188,38 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	31.08.2015	EUR	6,23 %	16,73 %	20,54 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	15.02.2013	GBP	3,48 %	13,36 %	38,39 %	198,47 %	
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	03.08.2018	PLN	9,24 %	20,68 %	31,70 %	–	
	FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09.05.2007	USD	10,44 %	20,08 %	25,39 %	77,51 %
		Klasse A USD, ausschüttend (A)	01.03.2004	USD	10,39 %	20,03 %	25,30 %	77,24 %
		Klasse A EUR, thesaurierend	01.10.2008	EUR	7,99 %	16,32 %	38,44 %	125,42 %
		Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	05.06.2013	EUR	7,97 %	17,18 %	16,82 %	46,62 %
		Klasse A EUR, ausschüttend (A)	09.02.2011	EUR	7,95 %	16,30 %	38,50 %	128,82 %
		Klasse A GBP ausschüttend (A)	05.11.2009	GBP	5,19 %	13,85 %	34,40 %	134,96 %
		Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	31.01.2013	SEK	7,60 %	17,05 %	16,23 %	40,94 %
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	9,89 %	19,48 %	23,53 %	68,83 %	
Klasse C USD, ausschüttend (A)		01.03.2004	USD	9,84 %	19,44 %	23,44 %	68,59 %	
Klasse E USD, thesaurierend		21.01.2010	USD	9,57 %	19,14 %	22,52 %	64,43 %	
Klasse E USD, ausschüttend (A)		03.06.2020	USD	9,57 %	19,14 %	22,45 %	–	
Klasse E EUR, thesaurierend		14.01.2019	EUR	7,22 %	15,51 %	35,58 %	–	
Klasse F USD, thesaurierend		21.01.2010	USD	11,06 %	20,75 %	27,57 %	88,20 %	
Klasse F USD, ausschüttend (A)		04.02.2010	USD	11,06 %	20,75 %	27,57 %	88,21 %	
Klasse X USD, thesaurierend		08.02.2013	USD	11,22 %	20,94 %	28,11 %	90,96 %	
Klasse X USD, ausschüttend (A)		15.04.2021	USD	11,31 %	21,11 %	–	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend		24.11.2009	USD	11,61 %	21,35 %	29,49 %	97,80 %	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		18.02.2011	USD	11,61 %	21,35 %	29,49 %	97,84 %	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)		20.05.2011	GBP	6,28 %	15,02 %	38,87 %	161,89 %	
Klasse LM EUR, thesaurierend		05.04.2016	EUR	10,08 %	18,58 %	46,58 %	–	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	11,06 %	20,75 %	27,57 %	88,19 %		
Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	10,50 %	20,15 %	25,68 %	79,02 %		
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	01.12.2021	USD	2,15 %	10,25 %	–	–	
	Klasse X USD, thesaurierend	01.12.2021	USD	2,94 %	11,08 %	–	–	
	Klasse X GBP, thesaurierend	11.08.2022	GBP	-2,09 %	5,20 %	–	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	01.12.2021	USD	3,29 %	11,47 %	–	–	
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	28.06.2016	USD	24,42 %	21,49 %	-10,92 %	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend	28.06.2016	EUR	21,70 %	17,75 %	-1,44 %	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	24.03.2021	EUR	21,42 %	18,26 %	–	–	
	Klasse C USD, thesaurierend	09.09.2021	USD	23,80 %	20,89 %	–	–	
	Klasse E USD, thesaurierend	14.08.2019	USD	23,49 %	20,58 %	-12,90 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	29.07.2021	USD	25,17 %	22,22 %	–	–	
	Klasse X USD, thesaurierend	01.04.2021	USD	25,34 %	22,41 %	–	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	28.06.2016	EUR	22,68 %	18,68 %	0,86 %	–	
	Klasse X GBP, thesaurierend	28.06.2016	GBP	19,45 %	16,08 %	-2,25 %	–	
	Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	28.06.2016	GBP	24,03 %	20,88 %	-13,18 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	28.06.2016	USD	25,79 %	22,82 %	-7,94 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	16.04.2019	GBP	24,46 %	21,28 %	-12,29 %	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	05.03.2021	EUR	23,17 %	19,96 %	–	–	
	Klasse S GBP, thesaurierend	28.06.2016	GBP	20,38 %	16,98 %	-0,20 %	–	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.23–29.02.24	Kalenderjahr 01.01.23–31.12.23	3 Jahre kumulativ 01.01.21–31.12.23	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.14–28.02.24
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	28.06.2016	USD	1,08 %	3,43 %	2,40 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus	28.06.2016	AUD	4,66 %	3,34 %	15,84 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)	28.06.2016	EUR	-1,08 %	0,29 %	13,29 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	12.09.2018	SGD	0,76 %	1,94 %	2,04 %	–
	Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	29.04.2020	AUD	-0,80 %	1,40 %	-1,76 %	–
	Klasse D CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	29.04.2020	CNH	-1,29 %	0,90 %	2,80 %	–
	Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus	29.04.2020	HKD	1,25 %	3,91 %	4,44 %	–
	Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	29.04.2020	SGD	-0,35 %	2,07 %	1,06 %	–
	Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	29.04.2020	USD	1,48 %	3,84 %	3,63 %	–
	Klasse D USD, thesaurierend	29.04.2020	USD	1,49 %	3,84 %	3,63 %	–
	Klasse X AUD, thesaurierend	31.05.2017	AUD	5,43 %	4,11 %	18,14 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	28.06.2016	USD	1,85 %	4,20 %	4,72 %	–
	Klasse S GBP, thesaurierend	28.06.2016	GBP	-2,31 %	-0,52 %	14,59 %	–
	Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	28.06.2016	GBP	-2,32 %	-0,52 %	14,56 %	–
	Klasse LM AUD, thesaurierend	10.11.2017	AUD	6,60 %	5,26 %	22,46 %	–
	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	24.11.2017	USD	1,00 %	4,39 %	-27,88 %
Klasse E USD, thesaurierend		10.09.2018	USD	0,23 %	3,61 %	-29,49 %	–
Klasse F USD, thesaurierend		13.11.2018	USD	1,60 %	5,01 %	-26,58 %	–
Klasse X USD, thesaurierend		13.12.2017	USD	1,69 %	5,12 %	-26,29 %	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		13.12.2017	USD	2,11 %	5,54 %	-25,47 %	–
Klasse S USD, thesaurierend		29.10.2018	USD	2,30 %	5,74 %	-25,02 %	–
Klasse S EUR, thesaurierend		16.01.2018	EUR	0,12 %	2,53 %	-16,96 %	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	15.10.2021	USD	19,92 %	20,49 %	–	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	09.11.2018	EUR	17,57 %	17,99 %	-1,42 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	15.10.2021	USD	19,01 %	19,57 %	–	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	09.11.2018	EUR	18,46 %	18,87 %	0,81 %	–
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	01.06.2021	BRL	26,85 %	28,20 %	–	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	09.11.2018	EUR	18,87 %	19,29 %	1,88 %	–
	Klasse S USD, thesaurierend	12.05.2022	USD	22,14 %	23,67 %	–	–
	Klasse S EUR, thesaurierend	07.05.2019	EUR	19,36 %	19,77 %	3,10 %	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	Klasse S GBP, thesaurierend	19.11.2021	GBP	16,20 %	17,14 %	–	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	23.01.2023	EUR	6,06 %	–	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	23.01.2023	EUR	6,07 %	–	–	–
	Klasse D EUR, thesaurierend	23.01.2023	EUR	5,49 %	–	–	–
	Klasse D EUR, ausschüttend (A)	23.01.2023	EUR	5,48 %	–	–	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	23.01.2023	EUR	6,47 %	–	–	–
	Klasse X EUR, ausschüttend (A)	23.01.2023	EUR	6,50 %	–	–	–

In den Wertentwicklungsdaten sind die Gebühren und Kosten für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Hinweis für die künftige Entwicklung.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024

Gemäß den OGAW-Verordnungen wird eine Aufstellung über die wichtigsten Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlageportfolios jedes Fonds während des Berichtszeitraums vorgelegt, um zu gewährleisten, dass die Anteilhaber die Veränderungen in den Anlagen der einzelnen Fonds erkennen können. Diese sind definiert als die gesamten Käufe und Verkäufe einer Anlage (einschließlich Fälligkeiten, aber ohne Reverse-Repo-Geschäfte, Tagesgeldscheinen und Termineinlagen, die hauptsächlich zur Gewährleistung einer effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt werden), die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe und Verkäufe für das Geschäftsjahr übersteigen. Es werden mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe aufgeführt. Sollte ein Fonds während des Geschäftsjahres weniger als zwanzig Käufe oder Verkäufe getätigt haben, sind alle Transaktionen aufgeführt.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 22.02.2024	42.813	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 22.02.2024	43.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 26.06.2023	42.382	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 26.06.2023	42.400
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 21.06.2023	40.505	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 21.06.2023	40.600
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 18.05.2023	37.892	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 18.05.2023	37.900
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 14.03.2023	34.996	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 27.11.2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 15.05.2023	34.986	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 15.05.2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 27.11.2023	34.985	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 14.03.2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 13.03.2023	32.288	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 13.03.2023	32.300
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 05.02.2024	29.987	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 05.02.2024	30.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 06.11.2023	29.919	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 29.09.2023	30.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 02.01.2024	29.700	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 06.11.2023	30.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 29.09.2023	29.676	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 24.11.2023	30.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 18.08.2023	29.617	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 02.01.2024	30.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 24.11.2023	29.599	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 18.08.2023	30.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 12.03.2024	26.278	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 25.09.2023	26.200
Federal Home Loan Banks Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,090 %, fällig am 25.09.2023	26.198	Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 16.05.2023	25.300
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 16.04.2024	25.886	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig am 16.03.2023	25.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, fällig am 16.05.2023	25.264	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 14.03.2023	25.000
Federal Farm Credit Banks Funding Corp Floating Rate Note – bei Ausgabe 0,000 %, fällig am 20.03.2024	25.001	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 06.06.2023	25.000
Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 5,350 %, fällig am 29.04.2024	24.997	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,000 %, fällig am 20.03.2024	25.000

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	95.539	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	94.172
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	8.458	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	8.448
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	7.793	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	7.472
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	7.473	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.07.2028	5.959
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.07.2028	6.091	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.12.2027	5.726
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	5.565	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	5.537
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	5.449	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	5.409
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.573	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.599
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.502	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.464
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.434	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.425
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	4.337	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.319
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.328	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	4.229
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.004	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.042
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	3.965	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.994
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.903	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	3.971
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.678	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.666
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.605	Ginnie Mae, 30 year, TBA, Nullkupon	3.651
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.567	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.562
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.560	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.519
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.514	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.500

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	27.049	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	27.473
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 29.02.2028	24.520	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 29.02.2028	24.827
United States Treasury Note/Bond, Nullkupon, fällig 31.05.2028	23.945	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.05.2028	23.890
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	19.023	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	22.824
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	18.324	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	18.485
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	18.120	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	18.308
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	17.327	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	17.858
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	16.648	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	17.546
United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, fällig 31.08.2030	16.384	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 31.01.2028	17.256
United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, fällig 30.09.2030	15.584	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	16.606
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.970	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2030	16.388
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.791	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	15.833
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.248	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.09.2030	15.570
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	13.621	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 31.01.2025	15.342
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	12.993	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	14.970
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.01.2031	12.865	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.847
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	12.515	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.797
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	12.514	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.316
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	12.086	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	12.927
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	12.003	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	12.829

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) EUR	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
WICHTIGSTE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	8.415	9.825
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig am 15.08.2032	3.895	8.266
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig am 15.07.2033	1.310	6.341
Goldman Sachs Group Inc/The, 0,875 %, fällig am 09.05.2029	1.220	3.711
Bundesobligation, 0,000 %, fällig am 04.10.26	900	3.496
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	829	3.475
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	823	3.427
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	816	2.561
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	786	2.160
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	708	2.117
Vodafone Group Plc, 2,875 %, fällig am 20.11.2037	694	1.850
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	684	1.525
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series I/L, 0,500 %, fällig am 15.04.2030	662	1.435
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	629	1.421
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007, 4,250 %, fällig am 04.07.2039	618	1.387
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	593	1.382
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	551	1.364
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	532	1.325
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	522	1.245
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	447	1.196

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	11.910	5.300
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 31.10.2027	11.729	4.021
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 0,000 %, fällig am 15.06.2035	5.300	3.656
Mexikanische Bonos, Series M, 8,500 %, fällig am 31.05.2029	4.019	2.010
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig am 15.11.2026	3.981	2.173
United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig am 31.03.2027	1.964	1.522
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig am 15.08.2043	1.628	1.522
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	1.513	1.335
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig am 15.11.2042	1.417	1.290
Vodafone Group Plc, 8,000 %, fällig am 30.08.2086	1.252	1.278
International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, fällig am 13.07.2029	1.092	1.166
Banco Santander SA, 5,750 %, fällig am 23.08.2033	1.083	1.162
Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig am 15.02.2033	1.056	1.141
European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, fällig am 26.10.2027	1.041	1.100
Sedgwick CMS Inc, 9,083 %, fällig am 17.02.2028	913	1.085
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, fällig am 14.03.2029	908	1.079
API Group De Inc, 7,701 %, fällig am 01.10.2026	882	1.018
Mosaic Solar Loan Trust 2023-4, Series 2023 4A, Class C, 144A, 8,800 %, fällig am 20.05.2053	849	1.002
Goldstory SAS, 6,750 %, fällig am 01.02.2030	845	970
Nidda Healthcare Holding GmbH, 7,500 %, fällig am 21.08.2026	844	951
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2031	840	913
ServiceMaster Funding LLC, Series 2021 1, Class A2II, 144A, 3,113 %, fällig am 30.07.2051	826	892
Altice Financing SA, 2,250 %, fällig am 15.01.2025	817	882
Altice France SA/France, 2,125 %, fällig am 15.02.2025	811	811
Neighborly Issuer 2023-1, Series 2023 1A, Class A2, 144A, 7,308 %, fällig am 30.01.2053	789	791
		770
		714
		686
		633
		587
		565
		499
		491
		461
		459
		448
		445
		420
		405

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset US High Yield Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	38.664
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	37.580	Open Text Corp, 144A, 6,900 %, fällig am 01.12.2027	1.719
Open Text Corp, 144A, 6,900 %, fällig am 01.12.2027	1.543	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027	1.345
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig am 01.06.2031	1.517	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig am 01.06.2031	1.305
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 14.04.2030	1.112	Bath & Body Works Inc, 7,500 %, fällig am 15.06.2029	1.299
GTCR W-2 Merger Sub LLC, 144A, 7,500 %, fällig am 15.01.2031	1.068	United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig am 15.01.2030	1.099
NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, fällig am 15.01.2029	927	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig am 09.05.2029	912
Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, ohne Laufzeitbegrenzung	822	Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	897
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	806	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 26.08.2028	887
Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig am 01.06.2030	796	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	867
BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, ohne Laufzeitbegrenzung	788	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig am 15.02.2027	852
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig am 01.03.2029	740	Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig am 03.05.2029	843
American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 15.05.2029	734	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig am 01.04.2044	787
UBS Group AG, 144A, 9,016 %, fällig am 15.11.2033	703	Sands China Ltd, 3,250 %, fällig am 08.08.2031	752
Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, fällig am 01.02.2032	696	Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, fällig am 15.04.2027	750
Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, ohne Laufzeitbegrenzung	682	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 01.02.2026	729
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig am 15.09.2031	681	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	718
Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	678	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	717
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig am 15.01.2026	674	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 01.11.2033	715
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig am 15.03.2032	632	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 15.05.2029	710
LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, fällig am 15.08.2030	610		

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig am 01.10.2026	992
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig am 30.04.2026	905	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	948
JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig am 15.12.2031	870	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig am 30.04.2026	908
ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 14.04.2028	578	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 15.04.2026	814
United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig am 15.11.2027	512	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig am 16.02.2028	765
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	502	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	690
Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig am 15.08.2029	501	Saga Plc, 5,500 %, fällig am 15.07.2026	682
Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig am 01.05.2025	499	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 31.08.2029	662
Panama, internationale Staatsanleihe, 2,252 %, fällig am 29.09.2032	498	VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig am 15.01.2032	631
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 03.05.2024	498	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	599
Vodafone Group Plc, 4,125 %, fällig am 30.05.2025	395	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	564
GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 01.06.2025	386	Internationale Staatsanleihe Türkei, 4,250 %, fällig am 14.04.2026	539
American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, fällig am 01.03.2025	384	NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2028	525
China Aoyuan Group I, 6,35 % 08.02.25, 0,000 %, fällig am 08.02.2025	384	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig am 31.12.2023	487
Ecopetrol SA, 8,375 %, fällig am 19.01.2036	278	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.04.2029	472
Nigeria, internationale Staatsanleihe, 144A, 7,143 %, fällig am 23.02.2030	270	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig am 28.02.2027	470
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, fällig 29.10.2033	262	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	469
Internationale Staatsanleihe Kolumbien, 3,125 %, fällig am 15.04.2031	261	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 15.05.2029	449
Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig am 15.10.2026	261	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	449
Comerica Bank, 2,500 %, fällig am 23.07.2024	253	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig am 15.08.2029	432
Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, ohne Laufzeitbegrenzung	253	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 15.05.2029	385
CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, fällig am 15.05.2028	250	China Aoyuan Group Ltd, 6,350 %, fällig am 08.02.2024	384
Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750 %, fällig am 15.03.2031	250	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,625 %, fällig am 15.01.2029	364
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 27.02.2024	250	Sands China Ltd, 3,250 %, fällig am 08.08.2031	332
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 28.12.2023	250	Carrolls Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 01.07.2029	328
Mexiko, internationale Staatsanleihe, 2,659 %, fällig am 24.05.2031	249	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig am 15.12.2031	306
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 02.01.2024	249	INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, fällig am 15.07.2026	305
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 05.09.2023	249	NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	305
TransDigm Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 01.12.2031	238	TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, fällig am 29.09.2023	300
T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig am 15.04.2026	235	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig am 01.06.2030	296
Stena International SA, 144A, 7,250 %, fällig am 15.01.2031	230	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig am 01.06.2032	294
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig am 01.03.2029	220	Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig am 13.01.2033	271
Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, fällig am 15.11.2031	220	FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.08.2026	255
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, ohne Laufzeitbegrenzung	219	MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, fällig am 01.02.2027	255
Banjay Entertainment SASU, 144A, 8,125 %, fällig am 01.05.2029	210		
Internationale Staatsanleihe Türkei, 4,875 %, fällig am 16.04.2043	208		
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig am 14.04.2030	203		
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig am 01.06.2031	200		
GTCR W-2 Merger Sub LLC, 144A, 7,500 %, fällig am 15.01.2031	200		
DCert Buyer, Inc., 9,333 %, fällig am 16.10.2026	199		
Rakuten Group Inc, 144A, 11,250 %, fällig am 15.02.2027	196		
Telecom Italia SpA, Milano, 144A, 5,303 %, fällig am 30.05.2024	196		
Internationale Staatsanleihe Oman, 6,750 %, fällig am 17.01.2048	195		
Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig am 28.10.2024	193		

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	132.837
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	134.452	Schatzanleihe Korea, Series 3006, 1,375 %, fällig am 10.06.2030	22.716
Staatsanleihe Malaysia, Series 0318, 4,642 %, fällig am 07.11.2033	22.731	Malaysia Staatsanleihe, Serie 0411, 4,232 %, fällig am 30.06.2031	17.146
Staatsanleihe China, Series INBK, 3,120 %, fällig am 25.10.2052	11.645	Staatsanleihe China, Series INBK, 3,390 %, fällig am 16.03.2050	15.057
Singapur, Staatsanleihe, 3,625 %, fällig am 01.08.2032	11.183	European Bank for Reconstruction & Development, 15,150 %, fällig am 16.02.2024	9.611
indonesische Staatsanleihe, Serie FR89, 6,875 %, fällig am 15.08.2051	10.613	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 07.07.2023	8.856
European Bank for Reconstruction & Development, 15,150 %, fällig am 16.02.2024	9.564	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 04.10.2023	8.524
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 07.07.2023	8.924	Schatzanleihe Indonesien, Series FR54, 9,500 %, fällig am 15.07.2031	8.495
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig am 31.07.2023	7.914	Internationale Staatsanleihe Philippinen, 6,250 %, fällig am 14.01.2036	8.334
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 21.07.2023	7.846	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig am 31.07.2023	7.920
Schatzanleihe Indonesien, Series FR97, 7,125 %, fällig am 15.06.2043	6.796	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 21.07.2023	7.880
Australien Staatsanleihe, 3,750 %, fällig am 21.04.2032	6.514	Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, fällig am 17.08.2071	7.609
Staatsanleihe Indien, 7,180 %, fällig am 24.07.2037	5.433	Schatzanleihe Korea, Series 2409, 3,125 %, fällig am 10.09.2024	7.607
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 28.04.2023	4.506	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig am 03.10.2023	7.413
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 23.06.2023	4.478	Schatzanleihe Korea, Series 2912, 1,375 %, fällig am 10.12.2029	7.145
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 31.03.2023	4.288	Indonesische Staatsanleihe, Serie FR59, 7,000 %, fällig am 15.05.2027	7.057
HSBC Holdings Plc, 7,260 %, fällig am 14.03.2033	3.692	Staatsanleihe China, Series INBK, 2,680 %, fällig am 21.05.2030	7.052
Staatsanleihe Indien, 7,260 %, fällig am 22.08.2032	3.575	United Overseas Bank Ltd, 3,875 %, Ewige Anleihe	6.896
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 13.10.2023	3.445	indonesische Staatsanleihe, Serie FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	6.868
Staatsanleihe Indien, 7,300 %, fällig am 19.06.2053	3.347	Schatzanleihe Korea, Series 3206, 3,375 %, fällig am 10.06.2032	6.604
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 87, Nullkupon, fällig am 15.09.2023	2.949	Schatzanleihe Indonesien, Series FR87, 6,500 %, fällig am 15.02.2031	6.410
Vietnam, internationale Staatsanleihe, 4,800 %, fällig am 19.11.2024	2.947	Staatsanleihe Malaysia, Series 0219, 3,885 %, fällig am 15.08.2029	5.797
		Export-Import Bank of China/The, Series 2007, 3,260 %, fällig am 24.02.2027	5.710
		Staatsanleihe Indien, Series SPB, 8,240 %, fällig am 15.02.2027	5.569
		Malaisische Staatsanleihe, Serie 0115, 3,955 %, fällig am 15.09.2025	5.409
		United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig am 15.12.2023	5.192
		International Finance Corp, 8,000 %, fällig am 09.10.2023	4.908
		Indische Staatsanleihe, 7,380 %, fällig am 20.06.2027	4.857

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	283.681
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	267.738	United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig am 15.12.2024	48.437
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027	42.467	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027	39.723
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2027	14.602	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2027	14.279
Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,125 %, fällig am 29.01.2027	13.012	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig am 15.05.2030	12.540
United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig am 15.12.2024	12.464	Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,125 %, fällig am 29.01.2027	12.529
Niederländische Waterschapsbank NV, 4,500 %, fällig am 18.06.2025	10.887	Niederländische Waterschapsbank NV, 4,500 %, fällig am 18.06.2025	10.887
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650 %, fällig am 19.05.2030	7.986	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,875 %, fällig am 18.07.2024	7.039
Caterpillar Financial Services Corp, 5,050 %, fällig am 27.02.2026	7.138	Niederländische Waterschapsbank NV, 4,500 %, fällig am 18.06.2025	6.233
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	5.380	Exxon Mobil Corp, 0,142 %, fällig am 26.06.2024	6.157
Bank of New York Mellon Corp/The, 4,947 %, fällig am 26.04.2027	5.200	Charles Schwab Corp/The, 1,950 %, fällig am 01.12.2031	5.813
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375 %, fällig am 21.10.2025	4.698	Nykredit Realkredit AS, 0,250 %, fällig am 13.01.2026	5.587
Nationwide Building Society, 6,125 %, fällig am 21.08.2028	4.345	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	5.302
Deutsche Boerse AG, 3,750 %, fällig am 28.09.2029	4.128	American Express Co, 4,900 %, fällig am 13.02.2026	5.213
Cargill Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 24.06.2026	3.992	NIKE Inc, 2,400 %, fällig am 27.03.2025	5.171
AbbVie Inc, 4,800 %, fällig am 15.03.2029	3.992	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig am 15.02.2030	4.632
NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig am 08.11.2027	3.940	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,375 %, fällig am 24.08.2031	3.929
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,000 %, fällig am 22.11.2028	3.859	Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig am 21.09.2028	3.816
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.08.2028	3.651	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.08.2028	3.646
Banco Santander SA, 4,250 %, fällig am 12.06.2030	3.425	Westpac Banking Corp, 0,625 %, fällig am 22.11.2024	3.188
Bristol-Myers Squibb Co, 4,900 %, fällig am 22.02.2029	3.403		

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig am 28.02.2025	15.827
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig am 15.04.2024	17.889	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig am 31.08.2025	8.846
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig am 31.08.2025	9.704	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig am 15.04.2024	6.724
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.08.2028	8.312	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.231
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.258	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.993
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.986	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.182
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.156	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 30.06.2023	4.716
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig am 31.10.2028	5.071	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.357
United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 30.06.2023	4.706	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.08.2028	4.186
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.407	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	3.752
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.676	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.660
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.595	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.576
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.569	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.562
Ginnie Mae 30 year, TBA, Nullkupon	3.553	Ginnie Mae 30 year, TBA, Nullkupon	3.553
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.394	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.350
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.326	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.333
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.275	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig am 31.10.2028	3.324
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.256	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.244
Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	3.204	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.229
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.190	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.196
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.946		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	16.551
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	16.061	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2029	647
JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, fällig am 24.02.2028	607	Bundesobligation, Serie 182, 0,000 %, fällig am 10.10.2025	569
Morgan Stanley, 4,656 %, fällig am 02.03.2029	581	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2031	518
McDonald's Corp, 5,450 %, fällig am 14.08.2053	379	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2029	516
Danske Bank A.S, 4,750 %, fällig am 21.06.2030	367	Banco Santander SA, 1,750 %, fällig am 17.02.2027	430
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2031	357	BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig am 14.12.2027	430
Thales SA, 4,125 %, fällig am 18.10.2028	317	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2027	418
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	285	NatWest Group Plc, 3,754 %, fällig am 01.11.2029	398
Bank of America Corp, 1,662 %, fällig am 25.04.2028	284	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig am 15.11.2052	390
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2029	284	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig am 01.06.2041	387
Corning Inc, 4,125 %, fällig am 15.05.2031	284	Stellantis NV, 5,250 %, fällig am 15.04.2023	360
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, fällig am 15.09.2029	271	Danske Bank A/S, 1,375 %, fällig am 12.02.2030	359
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2031	254	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig am 30.04.2028	345
Societe Generale SA, 5,750 %, fällig am 22.01.2032	254	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig am 15.05.2052	336
CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, fällig am 11.07.2031	250	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig am 15.11.2026	328
Wells Fargo & Co, 5,389 %, fällig am 24.04.2034	250	Suzano Austria GmbH, 7,000 %, fällig am 16.03.2047	303
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2029	249	AT&T Inc, Series B, 2,875 %, Ewige Anleihe	300
Vodafone Group Plc, 8,000 %, fällig am 30.08.2086	246	HSBC Holdings Plc, 5,875 %, ohne Laufzeitbegrenzung	291
BNP Paribas SA, 144A, 5,176 %, fällig am 09.01.2030	240	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig am 01.10.2024	290
UBS Group AG, 1,305 %, fällig am 02.02.2027	229		

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.333.612
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.357.026	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 31.01.2028	148.666
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	115.959	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	115.959
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	114.318	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	114.318
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 31.03.2028	101.356	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 31.03.2028	101.058
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	97.556	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	97.577
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	88.311	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	83.295
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	79.123	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	79.176
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	75.984	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	77.464
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.05.2028	72.352	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.05.2028	72.115
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	71.234	Ginnie Mae 30 year, TBA, 0,000 %	69.851
Ginnie Mae 30 year, TBA, 0,000 %	68.887	Ginnie Mae 30 year, TBA, 0,000 %	67.956
Ginnie Mae 30 year, TBA, 0,000 %	68.002	Ginnie Mae 30 year, TBA, 0,000 %	65.013
Ginnie Mae 30 year, TBA, 0,000 %	65.199	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	58.377
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	59.201	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	58.176
Freddie Mac Pool, 6,000 %, fällig am 01.07.2053	58.165	Freddie Mac Pool, 6,000 %, fällig am 01.07.2053	57.795
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	57.983	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	57.420
Fannie Mae Pool, 5,500 %, fällig am 01.08.2053	57.413	Fannie Mae Pool, 5,500 %, fällig am 01.08.2053	56.905
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	57.159	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig am 15.11.2052	56.779
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	54.592	Ginnie Mae 30 year, TBA, 0,000 %	56.017
United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig am 31.05.2030	54.085	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	55.265
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	53.189	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig am 31.05.2030	54.317
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	50.981	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	52.936
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2030	49.629	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	51.815
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	48.125	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2030	49.643
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 30.04.2028	42.250		

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		United States Treasury Note/Bond, 5,000 %, fällig 31.10.2025	3.948
United States Treasury Note/Bond, 5,000 %, fällig 31.10.2025	6.020	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	3.526
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	3.466	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	2.383
Mexikanische Bonos, Series M, 8,500 %, fällig am 31.05.2029	2.489	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 01.03.2026	2.198
Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig am 01.03.2028	1.905	Indonesische Staatsanleihe, Serie FR59, 7,000 %, fällig am 15.05.2027	1.936
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig am 01.02.2031	1.880	Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	1.845
Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig am 15.06.2039	1.867	UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Ewige Anleihe	1.820
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig am 01.06.2031	1.679	Comerica Bank, 2,500 %, fällig am 23.07.2024	1.652
Comerica Bank, 2,500 %, fällig am 23.07.2024	1.597	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig am 31.10.2027	1.605
American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig am 01.09.2026	1.557	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	1.472
DCert Buyer, Inc., 12,333 %, fällig am 16.02.2029	1.549	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig am 01.06.2031	1.441
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 01.03.2026	1.536	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.365
Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 15.02.2032	1.480	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625 %, fällig am 01.12.2025	1.305
CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, fällig am 15.05.2028	1.456	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 7,375 %, fällig am 01.03.2031	1.293
SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, fällig am 15.12.2028	1.450	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 15.03.2026	1.288
Triumph Group Inc, 144A, 9,000 %, fällig am 15.03.2028	1.432	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.259
Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig am 15.02.2031	1.389	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027	1.240
Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig am 06.10.2030	1.384	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class F, 144A, 8,824 %, fällig am 11.11.2034	1.215
Internationale Staatsanleihe Ivory Coast, 144A, 7,625 %, fällig am 30.01.2033	1.384	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig am 15.09.2031	1.206
CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, fällig am 31.01.2029	1.382	Hardee's Funding LLC, Series 2020 1A, Class A2, 144A, 3,981 %, fällig am 20.12.2050	1.199
Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	1.372		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	136.650
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	140.938	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Class M, 144A, 13,096 %, fällig am 15.06.2035	28.546
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Nullkupon, fällig am 15.06.2035	28.546	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.983
280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class F, 144A, 8,449 %, fällig am 15.09.2034	5.248	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Class B1, 144A, 7,867 %, fällig am 25.07.2049	4.854
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.985	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	4.705
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	4.711	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class B6, 144A, 3,591 %, fällig am 25.02.2048	4.629
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.492	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.478
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.090	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Klasse 1B1, 8,767 %, fällig am 25.02.2030	4.288
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.801	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Klasse 1B1, 9,186 %, fällig am 25.03.2031	4.156
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Klasse A3, 144A, 6,319 %, fällig am 25.05.2068	3.620	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.093
BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Series 2024 NQM2, Class M1, 144A, 6,819 %, fällig am 25.02.2064	3.500	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.807
Chase Mortgage Finance Trust Serie 2007-A1, Serie 2007 A1, Klasse 11M1, 4,321 %, fällig am 25.03.2037	3.199	PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Series 2021 1R, Class A, 144A, 8,358 %, fällig am 27.02.2024	3.690
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	2.963	BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Klasse MZB, 144A, 12,251 %, fällig am 15.07.2025	3.511
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.898	Freddie Mac STACR Debt Notes 2017-DNA2, Series 2017 DNA2, Class B2, 16,686 %, fällig am 25.10.2029	3.476
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Klasse C, 4,723 %, fällig am 15.01.2049	2.880	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Klasse 1B1, 9,436 %, fällig am 25.05.2030	3.436
Eagle RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 10,522 %, fällig am 26.09.2033	2.780	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Klasse 4A7, 144A, 3,662 %, fällig am 26.03.2037	3.383
Verus Securitization Trust 2024-1, Series 2024 1, Class B1, 144A, 7,909 %, fällig am 25.01.2069	2.750	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class B5, 144A, 3,591 %, fällig am 25.02.2048	3.087
GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Serie 2015 GC28, Klasse D, 144A, 4,306 %, fällig am 02.10.2048	2.732	FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Klasse B, 144A, 4,358 %, fällig am 25.02.2038	3.024
Morgan Stanley Capital I Trust 2016-BNK2, Series 2016 BNK2, Class B, 3,485 %, fällig am 15.11.2049	2.732	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-3, Serie 2017 3, Klasse M2, 144A, 4,750 %, fällig am 25.07.2056	2.983
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Klasse C, 4,420 %, fällig am 10.07.2047	2.717	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	2.943
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Klasse B1, 144A, 8,195 %, fällig am 25.05.2068	2.640		

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	231.747
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	248.095	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	66.838
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	66.691	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	47.613
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	47.321	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	42.065
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	42.326	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	41.208
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	41.173	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	38.752
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	39.103	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.257
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.520	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.035
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	36.733	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	35.550
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	35.533	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	35.425
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	35.424	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	35.321
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	35.290	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	33.838
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	34.077	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	31.475
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	31.475	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	31.208
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	31.202	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	30.791
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	30.716	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	30.498
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	30.634	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	27.976
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	28.230	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	27.004
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	27.138	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	26.971
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	26.824	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	26.906
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 %	26.446	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 %	26.453
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.892	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.909
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.838	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.610
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	25.211	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	25.325
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	24.658	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	23.701

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) GBP	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) GBP
WICHTIGSTE KÄUFE		Kreditanstalt für Wiederaufbau, 6,000 %, fällig am 07.12.2028	987
United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig am 22.07.2027	453	European Investment Bank, 1,375 %, fällig am 07.03.2025	769
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, fällig am 14.03.2029	359	European Investment Bank, 3,750 %, fällig am 07.12.2027	651
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, fällig am 02.11.2028	354	Banco Santander SA, 2,250 %, fällig am 04.10.2032	648
Engie SA, 5,625 %, fällig am 03.04.2053	296	Wells Fargo & Co, 4,875 %, fällig am 29.11.2035	530
Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig am 12.07.2027	267	Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig am 22.04.2025	520
Ford Motor Credit Co LLC, 6,860 %, fällig am 05.06.2026	217	UBS Group AG, VAR, fällig am 03.11.2028	520
ABN AMRO Bank NV, 5,250 %, fällig am 26.05.2026	199	Verizon Communications Inc, 1,875 %, fällig am 19.09.2030	456
Vereinigtes Königreich, Gilt, 0,375 %, fällig am 22.10.2026	198	United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig am 22.07.2027	454
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,500 %, fällig am 22.07.2026	196	DNB Bank ASA, 4,000 %, fällig am 17.08.2027	449
CPUK Finance Ltd, 5,876 %, fällig am 28.08.2027	190	British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig am 14.09.2029	448
Northern Gas Networks Finance Plc, 6,125 %, fällig am 02.06.2033	179	Barclays Plc, 3,250 %, fällig am 12.07.2027	443
Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig am 12.07.2040	178	Annington Funding Plc, 4,750 %, fällig am 09.08.2033	435
Vereinigtes Königreich, Gilt, 0,500 %, fällig am 31.01.2029	176	Leeds Building Society, 1,375 %, fällig am 06.10.2027	432
HSBC Holdings Plc, 6,332 %, fällig am 09.03.2044	167	Santander UK Group Holdings Plc, 2,920 %, fällig am 08.05.2026	413
Cadent Finance Plc, 5,750 %, fällig am 14.03.2034	150		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) GBP	WICHTIGSTE VERKÄUFE (in Tsd.) GBP	ERLÖSE (in Tsd.) GBP
WICHTIGSTE KÄUFE			
United Utilities Water Finance Plc, 5,125 %, fällig am 06.10.2038	139	BPCE SA, 2,500 %, fällig am 30.11.2032	407
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,625 %, fällig am 22.10.2028	122	Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig am 31.05.2027	406
Weir Group Plc/The, 6,875 %, fällig am 14.06.2028	110	E.ON International Finance BV, 6,125 %, fällig am 06.07.2039	387
NatWest Group Plc, 3,619 %, fällig am 29.03.2029	106	Credit Agricole SA, 4,875 %, fällig am 23.10.2029	376
National Gas Transmission Plc, 5,750 %, fällig am 05.04.2035	100	Derwent London Plc, 1,875 %, fällig am 17.11.2031	376
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	73		

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	35.559	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	35.559
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig am 15.05.2033	1.820	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig am 15.05.2033	1.811
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	1.053	Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, fällig am 05.05.2023	1.250
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.02.2053	1.032	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	1.099
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	1.010	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig am 12.02.2026	1.020
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	681	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.02.2053	992
ABN AMRO Bank NV, 6,339 %, fällig am 18.09.2027	500	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.08.2033	982
Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, fällig am 05.05.2023	490	Credit Suisse AG/New York NY, 0,520 %, fällig am 09.08.2023	930
HSBC Holdings Plc, 6,254 %, fällig am 09.03.2034	460	Bank of America Corp, 0,981 %, fällig am 25.09.2025	891
HEICO Corp, 5,250 %, fällig am 01.08.2028	459	Enel Finance International NV, 144A, 6,800 %, fällig am 14.10.2025	846
Bank of America Corp, 2,972 %, fällig am 04.02.2033	446	ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 29.04.2025	809
HCA Inc, 5,500 %, fällig am 01.06.2033	420	Citigroup Inc, 0,981 %, fällig am 01.05.2025	793
Bank of America Corp, 5,288 %, fällig am 25.04.2034	410	Morgan Stanley, 0,985 %, fällig am 10.12.2026	741
Electricité de France SA, 6,250 %, fällig am 23.05.2033	400	JPMorgan Chase & Co, 5,546 %, fällig am 15.12.2025	709
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, fällig am 19.05.2033	395	Amgen Inc, 5,250 %, fällig am 02.03.2033	690
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig am 26.06.2024	390	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	681
Morgan Stanley Bank NA, 4,754 %, fällig am 21.04.2026	390	Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, fällig am 09.01.2026	680
United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust, 5,800 %, fällig am 15.01.2036	390	Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, fällig am 01.04.2028	669
ONEOK Inc, 6,050 %, fällig am 01.09.2033	370	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,050 %, fällig am 15.02.2026	622
Morgan Stanley, 5,449 %, fällig am 20.07.2029	360	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 18.11.2038	619

Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.579	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	6.788
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 31.03.2028	938	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 31.03.2028	801
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	748	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2030	687
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2030	686	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 30.04.2028	470
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	582	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 30.11.2030	281
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 30.04.2028	470	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31.12.2027	237
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.01.2031	328	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.01.2031	216
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 30.11.2030	280	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	199
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 28.02.2031	279	Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctf Ser 2004-R10, Series 2004 R10, Class M6, 6,672 %, fällig am 25.11.2034	198
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig am 15.01.2033	266	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	197
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 31.03.2030	250	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 29.02.2028	185
Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig am 06.10.2030	241	Schatzanleihe Indonesien, Series FR87, 6,500 %, fällig am 15.02.2031	172
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.08.2053	236	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig am 15.02.2051	163
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig am 31.07.2030	209	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig am 15.08.2043	160
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	197	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	139
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	197	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig am 15.01.2033	123
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.02.2053	175	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	119
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig am 15.08.2043	157	Russische Bundesanleihe – OFZ, 0,000 %, fällig am 23.05.2029	105
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Klasse 1M2, 10,436 %, fällig am 25.07.2025	141	Ginnie Mae II Pool 'MA8490', 5,000 %, fällig am 20.12.2052	100
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	108	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	100

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2.987	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	3.017
European Investment Bank, 0,050 %, fällig am 15.11.2029	401	European Investment Bank, 0,050 %, fällig am 15.11.2029	406
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig am 15.05.2033	381	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig am 15.05.2033	378
European Investment Bank, 3,750 %, fällig am 14.02.2033	303	European Investment Bank, 3,750 %, fällig am 14.02.2033	291
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2031	264	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 15.08.2031	265
McDonald's Corp, 5,450 %, fällig am 14.08.2053	189	UBS Group AG, 1,500 %, fällig am 30.11.2024	210
tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, fällig am 02.11.2028	115	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig am 12.01.2024	199
E.ON SE, 3,750 %, fällig am 01.03.2029	108	HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig am 31.03.2030	195
Danske Bank A.S, 4,750 %, fällig am 21.06.2030	108	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 10.04.2027	194
Intesa Sanpaolo SpA, 5,125 %, fällig am 29.08.2031	108	BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, fällig am 13.01.2031	194
Bouygues SA, 3,875 %, fällig am 17.07.2031	107	Coöperatieve Rabobank UA, 3,250 %, ewige Anleihe	187
Morgan Stanley VAR, 4,656 %, fällig am 02.03.2029	106	McDonald's Corp, 5,450 %, fällig am 14.08.2053	187
Pandora A.S, 4,500 %, fällig am 10.04.2028	106	Standard Chartered Plc, 2,608 %, fällig am 12.01.2028	179
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.02.2053	102	GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, fällig am 18.07.2029	178
Banco Santander SA, 1,125 %, fällig am 17.01.2025	102	Allianz SE, 3,200 %, ewige Anleihe	150
NatWest Markets Plc, 2,000 %, fällig am 27.08.2025	102	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig am 01.06.2032	149
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig am 15.02.2028	99	Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, fällig am 07.10.2039	142
Bank of America Corp, 1,662 %, fällig am 25.04.2028	98	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	135
UBS Group AG, 1,000 %, fällig am 24.06.2027	95	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig am 01.10.2024	129

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^] – (Fortsetzung)

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	124
BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig am 30.05.2028	92		
European Investment Bank, 3,750 %, fällig am 15.06.2032	91		
T-Mobile USA Inc, 1,500 %, fällig am 15.06.2054	90		
European Investment Bank, 3,750 %, fällig am 13.11.2037	83		
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig am 15.05.2053	70		

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	84.043
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	86.639	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig am 15.11.2051	17.975
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	35.039	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,250 %, fällig am 19.10.2023	11.250
Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig am 21.04.2024	12.716	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,538 %, fällig am 31.07.2025	11.182
Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig am 14.03.2024	11.811	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 3,334 %, fällig am 31.07.2024	10.711
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig am 31.07.2051	11.539	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig am 15.08.2032	9.086
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,492 %, fällig am 31.07.2025	11.182	Schatzanleihe Korea, Serie 4412, 2,750 %, fällig am 10.12.2044	9.008
Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 20.09.2023	9.094	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 20.09.2023	8.981
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,501 %, fällig am 31.10.2025	8.753	Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, fällig am 28.04.2028	8.416
Vereinigtes Königreich, Gilt, 3,250 %, fällig am 31.01.2033	8.316	Vereinigtes Königreich, Gilt, 3,250 %, fällig am 31.01.2033	7.891
Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig am 28.05.2042	7.395	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig am 25.04.2032	7.884
International Bank for Reconstruction & Development, 2,500 %, fällig am 25.11.2024	7.159	United Kingdom Gilt, 0,750 %, fällig am 22.07.2023	7.223
Frankreich, internationale Staatsanleihe, 0,750 %, fällig am 25.05.2053	6.697	Frankreich, internationale Staatsanleihe, 0,750 %, fällig am 25.05.2053	6.839
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	6.255	Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig am 21.04.2024	6.635
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 5,125 %, fällig am 29.09.2025	6.191	Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig am 14.03.2024	6.326
German Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 17.04.2024	5.897	Staatsanleihe Norwegen, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig am 24.05.2023	5.833
Mexikanische Bonos, Serie MS, 8,000 %, fällig am 24.05.2035	5.766	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 18.11.2038	5.745
Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 31.03.2025	5.287	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.02.2052	5.682
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	4.388	Mexikanische Bonos, Series M, 8,500 %, fällig am 18.11.2038	5.485
Chile, internationale Staatsanleihe, 4,950 %, fällig am 05.01.2036	3.285	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, 0,000 %, fällig am 17.01.2024	5.468
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,250 %, fällig am 19.10.2023	2.448	Province of Manitoba Canada, 2,450 %, fällig am 02.06.2025	4.619
		United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	4.387
		United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033	4.259
		Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	4.256
		Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	4.237
		Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig am 28.05.2042	3.215
		International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig am 22.01.2026	2.952

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	257.032
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	265.123	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig am 15.08.2032	118.763
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	55.362	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	59.092
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig am 30.04.2025	54.401	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 3,334 %, fällig am 31.07.2024	46.137
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig am 15.08.2032	26.004	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2033	34.368
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2033	22.551	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	31.630
Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig am 28.05.2042	12.379	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig am 30.04.2025	31.300
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig am 31.07.2051	11.502	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	31.072
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig am 06.04.2026	11.316	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig am 25.04.2032	26.079
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig am 20.05.2053	9.137	Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig am 28.05.2042	23.363
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	9.118	Peruanische Staatsanleihe, 6,150 %, fällig am 12.08.2032	21.672
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig am 18.05.2026	9.111	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053	18.794
Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, fällig am 20.09.2053	7.515	Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050	17.556
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, fällig am 20.06.2053	6.707	Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig am 28.02.2048	15.610
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig am 28.02.2048	6.604	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 6,094 %, fällig am 14.03.2025	12.791
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, fällig am 20.06.2053	5.296	Freddie Mac Pool „SD8277“, 5,500 %, fällig am 12.01.2052	12.736
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, fällig am 20.02.2053	5.046	Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig am 01.09.2052	11.007
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig am 28.01.2060	4.602	Neuseeländische Staatsanleihe, Serie 0551, 2,750 %, fällig am 15.05.2051	10.860
Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, fällig am 20.11.2053	4.466	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig am 22.11.2024	10.651
Ginnie Mae II Pool 'MA9106', 5,500 %, fällig am 20.08.2053	1.703	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust, Series 2017 COR2, Class A3, 3,510 %, fällig am 10.09.2050	10.608
Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050	1.237		

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	22.046
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	22.763	Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.02.2028	1.142
Valvoline Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 15.02.2030	1.256	Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 15.05.2025	1.026
Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, fällig am 01.06.2028	1.137	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig am 01.05.2029	866
Petroleos Mexicanos, 5,950 %, fällig am 28.01.2031	1.048		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		WICHTIGSTE VERKÄUFE		ERLÖSE (in Tsd.) USD	
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, fällig am 15.04.2024		1.046	Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig am 15.11.2029			790
Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.02.2028		999	Petroleos Mexicanos, 5,950 %, fällig am 28.01.2031			725
Sabre GBLB Inc, 144A, 9,250 %, fällig am 15.04.2025		945	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, fällig am 01.06.2028			695
Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 01.02.2029		944	LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig am 15.10.2027			682
Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig am 01.05.2029		928	FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 01.01.2030			671
IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig am 15.06.2025		899	Minerva Luxembourg SA, 144A, 8,875 %, fällig am 13.09.2033			657
Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 15.05.2025		870	Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 7,250 %, fällig am 30.04.2030			650
FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 01.01.2030		791	Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, fällig am 01.12.2031			636
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 01.10.2026		774	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig am 15.05.2025			629
TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 15.03.2026		766	ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 15.08.2028			627
Vector Group Ltd, 144A, 10,500 %, fällig am 01.11.2026		701	Sabre GBLB Inc, 144A, 7,375 %, fällig am 01.09.2025			611
Lindblad Expeditions LLC, 144A, 6,750 %, fällig am 15.02.2027		698	Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 01.10.2026			602
Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig am 15.11.2029		680	Lindblad Expeditions Holdings Inc, 144A, 9,000 %, fällig am 15.05.2028			600
Athabasca Oil Corp, 144A, 9,750 %, fällig am 01.11.2026		666	Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig am 31.07.2026			596
Walgreens Boots Alliance Inc, 3,800 %, fällig am 18.11.2024		655	Sabre GBLB Inc, 144A, 9,250 %, fällig am 15.04.2025			591
PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 01.10.2029		652	Nordstrom Inc, 4,250 %, fällig am 01.08.2031			584

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		WICHTIGSTE VERKÄUFE		ERLÖSE (in Tsd.) USD	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		134.207	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)			130.627
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033		60.329	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig am 31.01.2025			32.770
Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig am 21.04.2024		29.444	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033			22.563
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,501 %, fällig am 31.10.2025		25.192	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,353 %, fällig am 31.07.2025			19.825
Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig am 14.03.2024		22.920	Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig am 21.04.2024			19.749
Vereinigtes Königreich, Gilt, 3,250 %, fällig am 31.01.2033		22.323	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.02.2052			17.472
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025		21.069	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,501 %, fällig am 31.10.2025			17.087
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,353 %, fällig am 31.07.2025		19.829	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig am 15.11.2051			16.082
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig am 31.07.2051		15.591	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig am 20.09.2023			15.182
Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig am 20.09.2023		15.436	Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig am 14.03.2024			13.848
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033		11.908	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig am 15.08.2032			10.807
Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig am 17.04.2024		9.477	Schatzanleihe Korea, Serie 3106, 2,000 %, fällig am 10.06.2031			10.611
Staatsanleihe Republik Frankreich OAT, 1,886 %, fällig am 25.05.2053		8.590	Vereinigtes Königreich, Gilt, 3,250 %, fällig am 31.01.2033			10.434
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053		8.507	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig am 25.04.2032			9.640
Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig am 17.01.2024		8.036	Staatsanleihe Republik Frankreich OAT, 1,886 %, fällig am 25.05.2053			8.759
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.02.2052		7.192	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig am 17.01.2024			8.239
Staatsanleihe Kanada, 2,000 %, fällig am 01.09.2023		4.561	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 3,334 %, fällig am 31.07.2024			7.073
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2033		3.577	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 31.05.2029			6.869
Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053		3.338	Staatsanleihe Kanada, 2,000 %, fällig am 01.09.2023			6.410
Staatsanleihe Neuseeland, 0,632 %, fällig am 15.05.2024		2.876	Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig am 31.07.2051			5.644
			United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032			4.859

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		WICHTIGSTE VERKÄUFE		ERLÖSE (in Tsd.) USD	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		829.015	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)			808.554
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025		227.318	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025			227.312
United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig am 22.10.2053		97.663	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse			109.237
Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053		59.076	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053			74.810
Mexikanische Bonos, Serie M, 7,500 %, fällig am 26.05.2033		39.916	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2033			57.129
International Bank for Reconstruction & Development, 4,625 %, fällig am 01.08.2028		38.575	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033			33.298
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,375 %, fällig am 18.07.2025		37.616	United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig am 22.10.2053			31.802
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig am 15.02.2033		35.584	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig am 26.03.2031			28.599
International Bank for Reconstruction & Development, 0,500 %, fällig am 28.10.2025		34.432	Ginnie Mae II Pool 'MA8646', 4,500 %, fällig am 20.02.2053			23.647
Staatsanleihe Spanien, 144A, 1,900 %, fällig am 31.10.2052		34.324	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 2,125 %, fällig am 07.08.2023			23.315
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2027		27.584	Peruanische Staatsanleihe, 6,150 %, fällig am 12.08.2032			20.739
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		23.883	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,800 %, fällig am 15.08.2053			20.600
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 2,125 %, fällig am 07.08.2023		23.248	Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig am 01.09.2052			20.519
Peruanische Staatsanleihe, 6,150 %, fällig am 12.08.2032		22.929	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,250 %, fällig am 08.03.2024			19.670
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053		20.748	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 7,622 %, fällig am 25.08.2033			19.391
Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050		20.320	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 2,625 %, fällig am 28.02.2024			19.137
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,250 %, fällig am 08.03.2024		19.029	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053			17.523
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 2,625 %, fällig am 28.02.2024		18.813	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig am 01.03.2025			15.707
Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig am 26.03.2031		17.776	Spanische Staatsanleihe, 3,550 %, fällig am 31.10.2033			14.505
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053		16.747	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse B1, 144A, 3,480 %, fällig am 25.03.2058			13.291

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	26.757	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	25.493
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	9.515	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	9.516
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,543 %, fällig am 31.07.2025	4.727	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,538 %, fällig am 31.07.2025	4.727
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig am 30.04.2025	3.884	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig am 30.04.2025	3.882
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Klasse B1, 144A, 10,536 %, fällig am 25.06.2050	2.008	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	2.216
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Klasse B1, 144A, 10,367 %, fällig am 25.07.2050	1.659	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Serie 2013 GC15, Klasse C, 5,170 %, fällig am 10.09.2046	2.091
Home RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 11,322 %, fällig am 25.10.2033	1.060	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Series 2021 DNA3, Class M2, 144A, 6,584 %, fällig am 25.10.2033	1.863
PDC Energy Inc, 5,750 %, fällig am 15.05.2026	1.030	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Series 2021 DNA7, Class M1, 144A, 5,334 %, fällig am 25.11.2041	1.833
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02, Series 2020 R02, Class 2B1, 144A, 0,000 %, fällig am 25.09.2043	1.030	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, Serie 2014 C14, Klasse A5, 4,064 %, fällig am 15.02.2047	1.805
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA1, Series 2023 DNA1, Class B1, 144A, 13,472 %, fällig am 25.03.2043	975	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA3, 144A, 10,770 %, fällig am 25.07.2050	1.673
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02, Series 2020 R02, Class 2B1, 144A, 0,000 %, fällig am 25.04.2043	780	GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, Klasse A2, 2,233 %, fällig am 21.06.2046	1.658
Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053	660	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1M2, 6,867 %, fällig am 25.07.2030	1.642
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02, Series 2020 R02, Class 2B1, 144A, 8,436 %, fällig am 25.01.2040	640	Fannie Mae Pool 'MA4876', 6,000 %, fällig am 12.01.2052	1.523
Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050	602	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1B1, 9,186 %, fällig am 25.10.2030	1.500
IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig am 15.06.2025	511	Freddie Mac Pool „SD8278“, 6,000 %, fällig am 12.01.2052	1.479
Mexikanische Bonos, Series M, 7,500 %, fällig am 26.05.2033	415	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	1.455
Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, fällig am 15.08.2028	415	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1B1, 8,986 %, fällig am 25.07.2030	1.369
Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, fällig am 20.11.2053	404	Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050	1.356
Fannie Mae – CAS Floating Rate Note, 0,000 %, fällig am 25.06.2043	370	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig am 01.01.2033	1.243
FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 09.01.2028	358	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Serie 2013 GC17, Klasse C, 5,110 %, fällig am 11.10.2046	1.226
		Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse 1B1, 144A, 8,836 %, fällig am 25.10.2039	1.173
		Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, Serie 2019 R06, Klasse 2B1, 144A, 8,367 %, fällig am 25.09.2039	1.171
		Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Klasse B1, 144A, 10,536 %, fällig am 25.06.2050	1.115
		STACR Trust 2018-HRP2, Series 2018 HRP2, Class B1, 144A, 9,636 %, fällig am 25.02.2047	1.086
		Home RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 11,322 %, fällig am 25.10.2033	1.065

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.058	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.058
Openlane inc, 5,125 %, fällig am 01.06.2025	97	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	411
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 01.10.2026	63	Uber Technologies Inc, 7,500 %, fällig am 15.05.2025	366
Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250 %, fällig am 15.04.2025	61	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.09.2028	309
Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 01.02.2026	60	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 15.03.2026	272
FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 09.01.2028	39	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	248
Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig am 30.03.2028	18	Horizon Therapeutics USA Inc, 5,500 %, fällig am 01.08.2027	227
Nordstrom Inc, 4,250 %, fällig am 01.08.2031	18	Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 01.02.2029	227
		Affinity Gaming, 144A, 6,875 %, fällig am 15.12.2027	218
		Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig am 01.05.2026	206
		Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig am 15.11.2029	201
		First Quantum Minerals Ltd, 6,500 %, fällig am 01.03.2024	199
		Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, fällig am 27.07.2032	198
		Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.02.2026	196
		MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig am 14.01.2031	187
		LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig am 15.10.2027	183
		Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 01.08.2026	178
		ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 15.08.2028	174
		Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 01.10.2026	172
		Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig am 15.03.2029	168
		Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2030	167
		Nissan Motor Acceptance Co LLC, 3,450 %, fällig am 15.03.2023	167
		Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig am 15.08.2026	153
		Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	151
		Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, fällig am 01.10.2026	148
		Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig am 15.11.2029	146
		United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig am 15.04.2029	140
		Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, fällig am 31.12.2024	134
		PDC Energy Inc, 5,750 %, fällig am 15.05.2026	129
		Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig am 30.06.2030	126
		Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 01.02.2026	120
		Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig am 15.01.2027	117
		Carnival Corp, 4,000 %, fällig am 01.08.2028	107

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Energiean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig am 30.03.2028	102
Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig am 15.08.2027	101
Ciramex Energy Co, 4,375 %, fällig am 15.03.2029	98
Home BancShares Inc AR, 3,125 %, fällig am 30.01.2032	98
Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2029	98

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	16.878	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	11.076
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig am 28.01.2060	2.126	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 3,334 %, fällig am 31.07.2024	7.556
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	1.605	Schatzanleihe Korea, Series 3106, 2,000 %, fällig am 10.06.2031	3.468
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig am 06.04.2026	1.416	Mexikanische Bonos, Series M, 8,500 %, fällig am 31.05.2029	2.269
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig am 18.05.2026	1.298	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig am 22.11.2024	1.439
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, fällig am 20.06.2053	1.294	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, fällig am 01.11.2024	1.383
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig am 20.05.2053	1.108	Jackson National Life Global Funding, 144A, 5,613 %, fällig am 28.06.2024	1.341
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, fällig am 20.06.2053	910	Schatzanleihe Korea, Series 5103, 1,875 %, fällig am 10.03.2051	1.146
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, fällig am 20.02.2053	891	Malaiische Staatsanleihe, Serie 0313, 3,480 %, fällig am 15.03.2023	910
Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	230	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	840
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2029	138	Malaiische Staatsanleihe, Serie 0417, 3,899 %, fällig am 16.11.2027	703
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, fällig am 01.11.2024	121	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig am 30.06.2032	448
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig am 28.02.2048	111	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2029	380
Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig am 30.06.2032	105	Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig am 28.02.2048	365
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	102	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	332
Freddie Mac Pool „SD8245“, 4,500 %, fällig am 09.01.2052	93	Tschechische Republik, Staatsanleihe, Serie 138, 1,750 %, fällig am 23.06.2032	290
Tschechische Republik, Staatsanleihe, Serie 138, 1,750 %, fällig am 23.06.2032	92	Malaiische Staatsanleihe, Serie 0115, 3,955 %, fällig am 15.09.2025	210
Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig am 22.11.2024	71	Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, fällig am 28.04.2028	183
Freddie Mac Pool „RA7790“, 5,000 %, fällig am 08.01.2052	67	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 18.11.2038	155
		Freddie Mac Pool „SD8277“, 5,500 %, fällig am 12.01.2052	133

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	9.361	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	8.782
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	3.946	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053	838
United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig am 22.10.2053	857	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig am 31.01.2025	800
Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 31.07.2053	667	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2022 HQA2, Class M1B, 144A, 8,484 %, fällig am 25.07.2042	622
Mexikanische Bonos, Serie M, 7,500 %, fällig am 26.05.2033	552	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2033	591
Staatsanleihe Spanien, 144A, 1,900 %, fällig am 31.10.2052	461	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01, Series 2022 R01, Class 1M2, 144A, 6,384 %, fällig am 25.12.2041	584
European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, fällig am 26.10.2027	428	European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, fällig am 26.10.2027	430
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2027	352	Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig am 01.09.2052	325
Mexikanische Bonos, Serie MS, 8,000 %, fällig am 24.05.2035	311	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig am 26.03.2031	292
Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig am 26.10.2050	282	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M1, 144A, 6,484 %, fällig am 25.03.2042	249
Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig am 26.03.2031	215	Freddie Mac Pool „SD8245“, 4,500 %, fällig am 09.01.2052	232
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Series 2022 DNA5, Class M2, 144A, 12,072 %, fällig am 25.06.2042	209	Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, fällig am 15.01.2028	211
Raizen Fuels Finance SA, 144A, 6,450 %, fällig am 05.03.2034	199	World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, fällig am 01.11.2026	206
Banco Do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, fällig am 18.04.2030	197	UBS AG/London, 144A, 0,700 %, fällig am 09.08.2024	205
Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1M1, 144A, 6,372 %, fällig am 25.01.2044	185	Banco Do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, fällig am 18.04.2030	203
Spanische Staatsanleihe, 3,550 %, fällig am 31.10.2033	182	BRF SA, 144A, 3,950 %, fällig am 22.05.2023	200
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R04, Series 2023 R04, Class 1M2, 144A, 8,871 %, fällig am 25.05.2043	181	NatWest Group Plc, 2,359 %, fällig am 22.05.2024	200
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R07, Series 2023 R07, Class 2M1, 144A, 7,271 %, fällig am 25.09.2043	169	Stellantis NV, 5,250 %, fällig am 15.04.2023	200
Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1M2, 144A, 7,122 %, fällig am 25.01.2044	160	Arab Petroleum Investments Corp, 144A, 1,483 %, fällig am 06.10.2026	198
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig am 01.01.2029	159	Export-Import Bank of India, 144A, 5,500 %, fällig am 18.01.2033	196
		Kenbourne Invest SA, 6,875 %, fällig am 26.11.2024	186
		Spanische Staatsanleihe, 3,550 %, fällig am 31.10.2033	183

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 29.02.2028	9.170	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	6.370
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	7.410	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig am 30.04.2025	3.341
United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig am 31.10.2028	5.769	Ginnie Mae II Pool 'MA9172', 6,000 %, fällig am 20.09.2053	1.359
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig am 30.04.2025	3.342	United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig am 31.10.2028	1.173
Ginnie Mae II Pool 'MA9241', 5,500 %, fällig am 20.10.2053	1.899	Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, fällig am 20.11.2053	1.105
Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, fällig am 20.09.2053	1.878	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig am 15.05.2052	634
Fannie Mae Pool 'MA4806', 5,000 %, fällig am 11.01.2052	1.421	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 29.02.2028	602
Ginnie Mae II Pool 'MA9362', 5,500 %, fällig am 20.12.2053	1.395	Ginnie Mae II Pool 'MA9107', 6,000 %, fällig am 20.08.2053	529
Ginnie Mae II Pool 'MA9172', 6,000 %, fällig am 20.09.2053	1.349	Ginnie Mae II Pool 'MA9241', 5,500 %, fällig am 20.10.2053	347
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	1.144	Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, fällig am 20.09.2053	319

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^] – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE			
Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, fällig am 20.11.2053	1.094	Fannie Mae Pool 'MA4806', 5,000 %, fällig am 11.01.2052	199
Ginnie Mae II Pool 'MA9305', 5,500 %, fällig am 20.11.2053	1.091	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig am 20.04.2053	27
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig am 20.05.2053	1.008	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig am 20.05.2053	17
Ginnie Mae II Pool 'MA8647', 5,000 %, fällig am 20.02.2053	793	Ginnie Mae II Pool 'MA8647', 5,000 %, fällig am 20.02.2053	14
Ginnie Mae II Pool 'MA9106', 5,500 %, fällig am 20.08.2053	715	Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, fällig am 20.02.2053	13
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, fällig am 20.06.2053	696	Fannie Mae Pool 'MA4869', 5,500 %, fällig am 01.01.2053	10
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	677	Ginnie Mae II Pool 'MA9305', 5,500 %, fällig am 20.11.2053	6
Fannie Mae Pool 'MA4869', 5,500 %, fällig am 01.01.2053	628	Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, fällig am 20.06.2053	5
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig am 18.05.2026	609	Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, fällig am 20.06.2053	4
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig am 15.05.2052	557	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	2
Ginnie Mae II Pool 'MA9488', 5,500 %, fällig am 20.02.2054	526		
Ginnie Mae II Pool 'MA9107', 6,000 %, fällig am 20.08.2053	525		
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, fällig am 20.02.2053	471		
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, fällig am 20.06.2053	470		

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	74	Cisco Systems Inc	111
Amgen Inc	40	Union Pacific Corp	84
Norfolk Southern Corp	20	Chubb Ltd	80
CSX Corp	18	3M Co	79
Marathon Petroleum Corp	17	Caterpillar Inc	76
Die Cigna-Gruppe	16	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	74
Williams Companies Inc	15	Amgen Inc	71
Chubb Ltd	10	KLA Corp	67
3M Co	9	Aflac Inc	63
Exelon Corp	9	Kroger Co/The	63
KLA Corp	9	Travelers Cos Inc/The	62
Pioneer Natural Resources	9	iShares Russell 1000 Value ETF	61
Union Pacific Corp	9	American International Group Inc	59
Lyondellbasell Industries NV	8	PIONEER NATURAL RESOURCES CO USD0,01	57
Mosaic Co /The	5	Die Cigna-Gruppe	56
Aflac Inc	4	Ulta Beauty Inc	52
American International Group Inc	4	Ameriprise Financial Inc	51
Expeditors Intern of Washington Inc	4	Marathon Petroleum Corp	51
Marathon Oil Corp	4	CSX Corp	49
Reinsurance Group Of America Inc	4	Laboratory Corp of America Holdings	48
Travelers Cos Inc/The	4	Fed Ex Corporation	47
		Quest Diagnostics Inc	47
		Exelon Corp	42
		Target Corp	42
		Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	41
		Omnicom Group Inc	41
		Capital One Financial Corp	39
		Southern Copper Corp	36
		Johnson & Johnson	35
		Hartford Financial Services Group Inc/The	34
		LKQ Corp	34
		Tyson Foods Inc 'A'	32
		Builders FirstSource Inc	31
		Discover Financial Services	30
		Principal Financial Group Inc	29
		Fifth Third Bancorp	27
		Lyondellbasell Industries NV	27

FTGF ClearBridge Value Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE			
Johnson & Johnson	40.784	Meta Platforms Inc 'A'	36.259
Bank of America Corp	30.409	Wells Fargo & Co	26.108
Hess Corp	24.702	Bank of America Corp	26.037
Pioneer Natural Resources Co	23.039	UnitedHealth Group Inc	25.699
United Parcel Service Inc 'B'	21.843	Pioneer Natural Resources Co	24.806
Block Inc	21.006	Uber Technologies Inc	20.317
ConocoPhillips	19.917	Equitable Holdings Inc	20.069
Gilead Sciences Inc	19.700	BioMarin Pharmaceutical Inc	19.519
Eastman Chemical Co	19.633	Hess Corp	18.336
American Tower Corp	19.062	Zimmer Biomet Holdings Inc	17.968
Union Pacific Corp	18.087	Royal Gold Inc	17.805
Apollo Global Management Inc	17.909	MGM Resorts International	17.041
PPL Corp	17.660	Vertex Pharmaceuticals Inc	15.570
CVS Health Corp	17.513	APA Corp	15.202
First Horizon Corp	17.286	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	15.180
Everest Group Ltd	17.226	Everest Re Group Ltd	14.862
Corebridge Financial Inc	16.436	Airbus SE	14.599
Tapestry Inc	15.356	EQT Corp	14.395
Teck Resources Ltd	13.118	AstraZeneca Plc ADR	14.183
Target Corp	12.593	SolarEdge Technologies Inc	14.013
Micron Technology Inc	12.465	T-Mobile US Inc	13.949

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge Value Fund – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Schlumberger NV	13.875
Argenx SE ADR	12.408	Ross Stores Inc	12.935
Marvell Technology Inc	12.406	M&T Bank Corp	12.654
Kellanova	12.312	Oracle Corp	12.624
NextEra Energy Inc	12.237	Constellation Energy Corp	12.432
Atkore Inc	12.170	American Electric Power Co Inc	11.918
Flowserve Corp	12.161	CVS Health Corp	11.742
Clean Harbors Inc	11.986	AGNC Investment Corp	11.014
UnitedHealth Group Inc	11.771	Black Knight Inc	10.969
Microsoft Corp	11.732	Teck Resources Ltd,	10.018
United Utilities Group Plc	11.567	Air Liquide SA	9.744
OneMain Holdings Inc	11.541	Teck Resources Ltd,	9.349
AGNC Investment Corp	11.485	Coty Inc	9.298
ICON Plc	11.218	United Airlines Holdings Inc	9.264
Canadian Pacific Kansas City Ltd	11.049	Tenet Healthcare Corp	9.231
Ross Stores Inc	10.976	Alibaba Group Holding Ltd	9.097
Teck Resources Ltd,	10.018	Sensata Technologies Holding Plc	8.741
Alibaba Group Holding Ltd	9.097	Haleon Plc	8.242
Alibaba Group Holding Ltd	9.052	Enbridge Inc	8.171
TotalEnergies SE ADR	9.018	TotalEnergies SE ADR	8.046
Performance Food Group Co	8.831	Mosaic Co/The	8.045
		Signature Bank/New York NY	7.998
		Micron Technology Inc	7.723
		Alcoa Corp	7.548

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Microsoft Corp	3.780
AbbVie Inc	2.308	Air Products & Chemicals Inc	3.369
Netflix Inc	2.211	Apple Inc	3.328
Crown Holdings Inc	1.719	UnitedHealth Group Inc	2.466
Meta Platforms Inc 'A'	1.697	ArcelorMittal SA	2.071
Amazon.com Inc	1.533	Pfizer Inc	1.997
Apple Inc	1.462	Home Depot Inc/The	1.720
Microsoft Corp	1.345	T-Mobile US Inc	1.457
US Bancorp	1.310	JPMorgan Chase & Co	1.452
Emerson Electric Co	1.260	Amazon.com Inc	1.421
Linde Plc	1.061	Progressive Corp/The	1.410
Marvell Technology Inc	1.048	Bank of America Corp	1.314
Synopsys Inc	1.027	Verizon Communications Inc	1.287
Bank of America Corp	985	TJX Cos Inc/The	1.284
Becton Dickinson & Co	968	Thermo Fisher Scientific Inc	1.214
NVIDIA Corp	889	Pioneer Natural Resources Co	1.134
Intel Corp	783	Ball Corp	1.104
Hartford Financial Services Group Inc/The	766	Travelers Cos Inc/The	1.073
Progressive Corp/The	707	Johnson & Johnson	973
ASML Holding NV	568	Visa Inc 'A'	966
Stryker Corp	551	Becton Dickinson & Co	905
Intercontinental Exchange Inc	543	Merck & Co Inc	863
UnitedHealth Group Inc	437	NVIDIA Corp	847
Visa Inc 'A'	428	Automatic Data Processing Inc	828
Merck & Co Inc	389	Alphabet Inc 'A'	808
Walt Disney Co/The	364	Alphabet Inc	789
JPMorgan Chase & Co	358	General Motors Co	745
		Honeywell International Inc	745
		Marriott International Inc.MD	744
		Comcast Corp	698
		Eli Lilly & Co	631
		United Parcel Service Inc 'B'	629
		Eaton Corp Plc	598
		Waste Management Inc	579

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		NVIDIA Corp	35.339
S&P Global Inc	27.173	Splunk Inc	27.390
Union Pacific Corp	25.180	S&P Global Inc	26.035
Target Corp	24.429	Atlassian Corp	21.384
Atlassian Corp	22.058	Dexcom Inc	19.532
Meta Platforms Inc 'A'	20.401	Visa Inc 'A'	14.111
Eli Lilly & Co	19.713	S&P Global Inc	13.306
Intuit Inc	18.491	Advance Auto Parts Inc	11.180
Thermo Fisher Scientific Inc	16.112	Monster Beverage Corp	11.095
Microsoft Corp	13.465	Honeywell International Inc	9.015
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	11.458	Zoetis Inc	8.830
Amazon.com Inc	11.436	Eaton Corp Plc	8.685
Intercontinental Exchange Inc	10.552	Palo Alto Networks Inc	8.385
NVIDIA Corp	9.770	Uber Technologies Inc	8.239
NextEra Energy Inc	9.426	Microsoft Corp	8.061
Apple Inc	9.327		

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (continued)

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Netflix Inc	9.261	WW Grainger Inc	7.881
Adobe Inc	9.067	Thermo Fisher Scientific Inc	7.204
Visa Inc 'A'	8.757	Amazon.com Inc	7.060
Honeywell International Inc	8.699	United Parcel Service Inc 'B'	7.004
Sherwin-Williams Co/The	8.015	Netflix Inc	6.815
Stryker Corp	6.601	Salesforce Inc	6.676
UnitedHealth Group Inc	5.818	UnitedHealth Group Inc	6.107
Intel Corp	4.812	Sea Ltd ADR	5.709
WW Grainger Inc	4.337	Stryker Corp	5.609
Palo Alto Networks Inc	4.237	Meta Platforms Inc 'A'	4.950
Salesforce Inc	3.983	Apple Inc	4.367
		NIKE Inc	4.322
		Marsh & McLennan Cos Inc	3.996
		Unity Software Inc	3.818

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
AbbVie Inc	4.162	Broadcom Inc	12.577
Airbnb Inc	3.942	Vertex Pharmaceuticals Inc	7.519
TJX Companies, Inc/The	3.671	Broadcom Inc	5.967
ServiceNow Inc	3.197	UnitedHealth Group Inc	5.341
Pinterest Inc	3.080	TE Connectivity Ltd	5.183
Starbucks Corp	2.504	AbbVie Inc	4.162
Broadcom Inc	2.476	Airbnb Inc	3.942
Cintas Corp	2.171	Comcast Corp	3.884
WW Grainger Inc	1.960	Seagate Technology Holdings Plc	2.959
MongoDB Inc 'A'	1.884	HubSpot Inc	2.590
Accenture Plc 'A'	1.843	Crowdstrike Holdings Inc	2.547
Paylocity Holding Corp	992	Liberty Broadband Corp	2.540
Freeport-McMoRan Inc	872	Meta Platforms Inc 'A'	2.213
Diageo Plc ADR	613	Johnson Controls International plc	2.166
Tractor Supply Co	447	Biogen Inc	2.023
elf Beauty Inc	405	Autodesk Inc	1.983
elf Beauty Inc	405	Ionis Pharmaceuticals Inc	1.806
Etsy Inc	349	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	1.802
Airbnb Inc	312	Liberty Broadband Corp	1.433
Old Dominion Freight Line Inc	309	Madison Square Garden Entertainment Corp	1.380
		Warner Bros Discovery Inc	1.330
		Etsy Inc	1.275
		Guardant Health Inc	1.165
		Charles River Laboratories International Inc	1.161
		AbbVie Inc	1.054
		Lyft Inc	965
		Madison Square Garden Sports Corp	894

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Apollo Global Management Inc	831	Microsoft Corp	1.665
NextEra Energy Partners LP	664	Broadcom Inc	1.121
NextEra Energy Inc	644	KKR & Co Inc, Serie C	1.003
American Homes 4 Rent 'A'	624	Apple Inc	760
Blackstone Inc	606	NextEra Energy Inc	662
Extra Space Storage Inc	560	Raytheon Technologies Corp	621
Digital Realty Trust Inc	538	Activision Blizzard Inc	608
US Bancorp	538	Bank of America Corp	593
Union Pacific Corp	507	Danaher Corp	586
AbbVie Inc	502	American Airlines Group Inc, 6,500 %, fällig am 01.07.2025	513
American Tower Corp	501	Cisco Systems Inc	508
McCormick & Co Inc/MD	498	AGNC Investment Corp	472
Sempra	465	Chubb Ltd	463
Prologis Inc	441	Pfizer Inc	454
Equity LifeStyle Properties Inc	436	Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP	442
Boston Properties Inc	418	Air Products & Chemicals Inc	411
T-Mobile US Inc	415	Aptiv Plc, Serie A	411
Marvell Technology Inc	377	Verizon Communications Inc	411
PPL Corp	353	ConocoPhillips	407
Colgate-Palmolive Co	341	Kimberly-Clark Corp	402
Apartment Income REIT Corp	333	Alexandria Real Estate Equities Inc	387
ONEOK Inc	322	Texas Instruments Inc	368
Pioneer Natural Resources Co	275	TC Energy Corp	358
Meta Platforms Inc 'A'	271	DT Midstream Inc	353
Amphenol Corp 'A'	265	American Tower Corp	326
AGNC Investment Corp	264	Equitrans Midstream Corp	302
Target Corp	264	US Bancorp	300
Eli Lilly & Co	260	NextEra Energy Partners LP	296
Abbott Laboratories	250	Otis Worldwide Corp	296
Chubb Ltd	230	Apollo Global Management Inc	255
Starwood Retail Property Trust Inc	195	QUALCOMM Inc	211
ConocoPhillips	193	Goldman Sachs Group Inc/The	208

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE

L3Harris Technologies Inc	187
Goldman Sachs Group Inc/The	185
Ares Capital Corp	152

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD

187
185
152

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

WICHTIGSTE KÄUFE

JPMorgan Chase & Co	51.925
Procter & Gamble Co/The	29.342
Colgate-Palmolive Co	28.684
American Water Works Co Inc	26.694
Travelers Cos Inc/The	23.286
Hologic Inc	22.459
ASML Holding NV	21.911
Lam Research Corp	21.607
Brookfield Renewable Corporation	20.697
Broadcom Inc	20.456
Ormat Technologies Inc	17.115
Veralto Corp	16.762
LKQ Corp	13.647
Marvell Technology Inc	10.698
Dell Technologies Inc	10.467
Alphabet Inc 'A'	9.538
Microsoft Corp	8.411
SolarEdge Technologies Inc	8.060
Danaher Corp	7.704
Enphase Energy Inc	7.448
CVS Health Corp	5.998
Apple Inc	5.852
NextEra Energy Partners LP	5.128

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD

51.925
29.342
28.684
26.694
23.286
22.459
21.911
21.607
20.697
20.456
17.115
16.762
13.647
10.698
10.467
9.538
8.411
8.060
7.704
7.448
5.998
5.852
5.128

WICHTIGSTE VERKÄUFE

Microsoft Corp	52.153
Apple Inc	43.877
Progressive Corp/The	37.872
ON Semiconductor Corp	37.734
Bank of America Corp	37.054
TE Connectivity Ltd	33.484
Keysight Technologies Inc	28.845
Thermo Fisher Scientific Inc	28.707
ASML Holding NV	26.595
Brookfield Renewable Corp	26.548
Charles Schwab Corp/The	25.838
Deere & Co	25.647
Booking Holdings Inc	23.527
UnitedHealth Group Inc	22.248
Progyny Inc	19.247
Novo Nordisk A.S ADR	18.008
Costco Wholesale Corp	17.481
Trane Technologies Plc	17.165
Hartford Financial Services Group Inc/The	15.935
Brookfield Renewable Corporation	15.660
Visa Inc 'A'	15.227
Salesforce Inc	14.329
Cisco Systems Inc	14.312
McCormick & Co Inc/MD	14.294
BioMarin Pharmaceutical Inc	14.178
Regal Rexnord Corp	13.873
Alphabet Inc 'A'	13.727
JPMorgan Chase & Co	13.507
NextEra Energy Partners LP	13.189
Morgan Stanley	13.068
Eaton Corp Plc	12.877
Synopsys Inc	12.484
Etsy Inc	10.594
ASML Holding NV	10.391
Cooper Cos Inc/The	10.137
Home Depot Inc/The	10.097
Williams-Sonoma Inc	9.970

ERLÖSE (in Tsd.) USD

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE

Marvell Technology Inc	320
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	299
Meta Platforms Inc 'A'	280
Visa Inc 'A'	250
Novo Nordisk A/S	249
CRH Plc	229
HDFC Bank Ltd ADR	227
Apple Inc	225
Adobe Inc	215
MercadoLibre Inc	214
Walt Disney Co/The	213
Tokyo Electron Ltd	202
Netflix Inc	188
Trex Co Inc	184
Waste Connections Inc	178
Intuit Inc	174
Kering SA	169
London Stock Exchange Group Plc	166
Haleon Plc	162
ASML Holding NV	158
TransDigm Group Inc	158
Target Corp	155
Amazon.com Inc	154
CRH Plc ADR	147
Uber Technologies Inc	146
Hoya Corp	142
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	140
SMC Corp	139
RELX Plc	134
Arista Networks Inc	124
Chubb Ltd	124
Ferrari NV	124
Industria de Diseno Textil SA	112

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD

320
299
280
250
249
229
227
225
215
214
213
202
188
184
178
174
169
166
162
158
158
155
154
147
146
142
140
139
134
124
124
124
112

WICHTIGSTE VERKÄUFE

Tesla Inc	328
Kroger Co/The	279
Deutsche Boerse AG	227
Tokyo Electron Ltd	218
Daiichi Sankyo Co Ltd	211
Procter & Gamble Co/The	206
Waste Connections Inc	196
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	187
EDP – Energias de Portugal SA	186
UnitedHealth Group Inc	186
Deere & Co	185
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	181
CRH Plc ADR	179
Eli Lilly & Co	176
Karuna Therapeutics Inc	174
BNP Paribas SA	172
Marvell Technology Inc	170
Nestle SA	170
Rentokil Initial Plc	170
London Stock Exchange Group Plc	167
Marriott International Inc.MD	167
Microsoft Corp	166
Diageo Plc ADR	162
Raymond James Financial Inc	161
Arista Networks Inc	147
NVIDIA Corp	146
Thomson Reuters Corp	146
Straumann Holding AG	144
RELX Plc	143
Tencent Holdings Ltd	138
Keyence Corp	133
Sysco Corp	132
Computershare Ltd	131

ERLÖSE (in Tsd.) USD

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE			
Pinterest Inc	111	CRH Plc ADR	127
Amphenol Corp 'A'	108	Alibaba Group Holding Ltd	126
Grupo Bimbo SAB de CV	107	Kering SA	125
Guidewire Software Inc	106	United Parcel Service Inc 'B'	122
Alphabet Inc 'A'	105	Sandvik AB	121
SAP SE	102	Sensient Technologies Corp	120
Salesforce Inc	100	Target Corp	120
Hexagon AB	99	Apple Inc	119
Edenred SE	98	United Rentals Inc	112
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	96	Avantor Inc	111
McKesson Corp	96	Iberdrola SA ADR	109
Shopify Inc 'A'	95	SAP SE	108
		Old Dominion Freight Line Inc	96
		S&P Global Inc	95
		Trex Co Inc	93
		Deutsche Telekom AG	92

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE			
CenterPoint Energy Inc	40.646	SSE Plc	48.286
Enel SpA	39.213	PPL Corp	43.422
Dominion Energy Inc	32.795	Iberdrola SA	39.128
Aéroports de Paris SA	29.633	TC Energy Corp	34.797
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	27.302	Union Pacific Corp	31.042
Norfolk Southern Corp	26.642	Cellnex Telecom SA, 144A	28.255
Crown Castle Inc	22.928	East Japan Railway Co	27.784
Severn Trent Plc	22.012	Vinci SA	25.884
Orsted AS, 144A	21.552	Aena SME SA, 144A	25.787
Union Pacific Corp	19.973	Ferrovial SE	24.507
E.ON SE	19.529	Severn Trent Plc	24.021
Rumo SA	19.101	CenterPoint Energy Inc	23.606
Entergy Corp	17.581	Constellation Energy Corp	22.228
Redeia Corp SA	17.385	PG&E Corp	22.033
PG&E Corp	15.593	Terna – Rete Elettrica Nazionale	22.014
Ferrovial SA	14.662	American Water Works Co Inc	20.459
CSX Corp	14.332	Southwest Gas Holdings Inc	19.545
United Utilities Group Plc	14.142	Public Service Enterprise Group Inc	17.008
Centrais Eletricas Brasileiras SA	10.631	Transurban Group	16.496
EDP – Energias de Portugal SA	9.866	Enel SpA	15.396
American Tower Corp	8.970	NextEra Energy Inc	14.385
PPL Corp	8.848	United Utilities Group Plc	14.347
Ferrovial SE	8.253	Atlas Arteria Ltd	14.055
Terna – Rete Elettrica Nazionale	6.328	CSX Corp	13.803
NextEra Energy Inc	5.800	Getlink SE	13.218
		American Tower Corp	13.014
		Cheniere Energy Inc	11.945
		Centrais Eletricas Brasileiras SA	11.806
		Central Japan Railway Co	10.856
		EDP – Energias de Portugal SA	10.524
		Gibson Energy Inc	9.876
		Entergy Corp	9.580
		Pembina Pipeline Corp	7.877
		OGE Energy Corp	7.526

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE			
Enbridge Inc	28.165	Iberdrola SA	31.323
Enel SpA	27.221	Enbridge Inc	29.551
Williams Cos Inc/The	22.914	Williams Cos Inc/The	28.905
Iberdrola SA	17.515	SSE Plc	26.091
NextEra Energy Inc	16.368	TC Energy Corp	20.566
Dominion Energy Inc	14.183	Enel SpA	16.171
National Grid Plc	13.268	Edison International	15.764
Eversource Energy	11.859	National Grid Plc	14.819
Union Pacific Corp	10.563	APA Group	14.265
NextEra Energy Partners LP	10.320	Public Service Enterprise Group Inc	11.715
Entergy Corp	9.847	Brookfield Renewable Corp	10.163
Redeia Corp SA	9.644	Enagas SA	9.442
Edison International	9.528	Snam SpA	9.127
Brookfield Renewable Corporation	9.241	United Utilities Group Plc	8.495
Snam SpA	8.431	West Japan Railway Co	7.603
Aéroports de Paris SA	7.341	Transurban Group	6.841
Severn Trent Plc	7.112	Southwest Gas Holdings Inc	6.699
Crown Castle Inc	6.339	Italgas SpA	6.610
TC Energy Corp	6.157	Clearway Energy Inc 'C'	6.231
E.ON SE	5.592	Redeia Corp SA	5.670
SSE Plc	5.575	Centrais Eletricas Brasileiras SA	5.653
Centrais Eletricas Brasileiras SA	5.425	Union Pacific Corp	5.416
China Resources Gas Group Ltd	4.459	Gibson Energy Inc	5.013

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
American Tower Corp	3.910	CPFL Energia SA	4.883
West Japan Railway Co	3.653	EDP – Energias de Portugal SA	4.085
Southern Co/The	3.368	Engie Brasil Energia SA	3.937
OGE Energy Corp	3.092		

FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
TotalEnergies SE	364	Eastman Chemical Co	201
Compass Group Plc	320	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT ADR	147
AstraZeneca Plc	277	TotalEnergies SE	116
Unilever Plc	270	Compass Group Plc	105
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	264	General Motors Co	90
Oracle Corp	260	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	89
Johnson & Johnson	253	AstraZeneca Plc	88
Wells Fargo & Co	240	Oracle Corp	86
Fiserv Inc	238	Unilever Plc	85
BNP Paribas SA	237	Fiserv Inc	79
Hitachi Ltd	231	Johnson & Johnson	79
American International Group Inc	231	Wells Fargo & Co	77
Chesapeake Energy Corp	230	American International Group Inc	76
Meta Platforms Inc 'A'	222	Meta Platforms Inc 'A'	75
UnitedHealth Group Inc	184	Chesapeake Energy Corp	75
Eastman Chemical Co	184	BNP Paribas SA	73
Freeport-McMoRan Inc	183	Fluence Energy Inc	62
Siemens AG	183	UnitedHealth Group Inc	62
Coty Inc	179	Schneider Electric SE	59
Nexans SA	177	Siemens AG	59
Veolia Environnement SA	176	Freeport-McMoRan Inc	55
Schneider Electric SE	176	Veolia Environnement SA	54
AES Corp/The	161	Coty Inc	53
Uber Technologies Inc	150	AES Corp/The	53
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT ADR	144	Uber Technologies Inc	53
Gerresheimer AG	138	Nexans SA	53
Charles Schwab Corp/The	133	Charles Schwab Corp/The	43
Vertiv Holdings Co 'A'	121	Gerresheimer AG	41
General Motors Co	108	Brookfield Renewable Corp	30
AIA Group Ltd	105	Biogen Inc	28
United Utilities Group Plc	104	CNH Industrial NV	24
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	102		
Brookfield Renewable Corp	100		
NextEra Energy Inc	98		
Biogen Inc	93		
CNH Industrial NV	85		
Fluence Energy Inc	84		

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	170.374	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	185.377
Alpha & Omega Semiconductor Ltd	5.348	Modine Manufacturing Co	8.197
WNS Holdings Ltd ADR	4.436	Earthstone Energy Inc 'A'	5.769
IPG Photonics Corp	4.032	Limbach Holdings Inc	5.423
Clearfield Inc	3.752	CIRCOR International Inc	5.221
Mativ Holdings Inc	3.630	Onto Innovation Inc	4.616
Canaccord Genuity Group Inc	3.356	BlueLinX Holdings Inc	4.598
CECO Environmental Corp	3.266	Heritage-Crystal Clean Inc	4.331
Patterson-UTI Energy Inc	3.217	Carrols Restaurant Group Inc	4.323
Udemy Inc	3.052	Chesapeake Energy Corp	4.270
Brighthouse Financial Inc	2.903	Griffon Corp	4.234
Select Water Solutions Inc	2.836	Haynes International Inc	4.144
Digi International Inc	2.802	Hexcel Corp	4.142
Xerox Holdings Corp	2.781	Daseke Inc	4.039
Gentherm Inc	2.713	Avid Technology Inc	3.919
Chart Industries Inc	2.670	Dorian LPG Ltd	3.850
TTEC Holdings Inc	2.611	PCTEL Inc	3.840
Fabrinet	2.606	Sterling Infrastructure Inc	3.811
Customers Bancorp Inc	2.588	Option Care Health Inc	3.671
Coherent Corp	2.554	Coherent Corp	3.566

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	30.313	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	29.733
FormFactor Inc	2.597	FormFactor Inc	3.250
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	2.523	Onto Innovation Inc	2.404
Kennedy-Wilson Holdings Inc	1.825	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	2.260
Catalyst Pharmaceuticals Inc	1.722	Avid Technology Inc	1.776
Enpro Inc	1.706	MKS Instruments Inc	1.488

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Royce US Smaller Companies Fund – (continued)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
MAJOR PURCHASES		Lazard Inc	1.449
Lazard Inc 'A'	1.498	Inter Parfums Inc	1.434
Ziff Davis Inc	1.440	White Mountains Insurance Group Ltd	1.298
John Bean Technologies Corp	1.243	John Bean Technologies Corp	1.180
Bio-Techne Corp	1.236	Computer Task Group Inc	1.123
Cass Information Systems Inc	1.235	AMN Healthcare Services Inc	1.103
Korn Ferry	1.221	Ironwood Pharmaceuticals Inc 'A'	988
Valvoline Inc	1.211	Houlihan Lokey Inc 'A'	979
Marcus & Millichap Inc	1.183	Harmony Biosciences Holdings Inc	973
Lazard Ltd 'A'	1.177	Heritage-Crystal Clean Inc	956
Ryerson Holding Corp	1.164	Forward Air Corp	951
Inter Parfums Inc	1.132	Kadant Inc	940
MKS Instruments Inc	1.115	Wolverine World Wide Inc	939
Forrester Research Inc	1.090	Louisiana-Pacific Corp	852
Cirrus Logic Inc	1.062	LCI Industries	845
Brunswick Corp.DE	999	Skyline Champion Corp	832
Vishay Precision Group Inc	981	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	808
AMN Healthcare Services Inc	979	Enovis Corp	798
Dun & Bradstreet Holdings Inc	937		
Arcosa Inc	919		
Brady Corp 'A'	861		
ESCO Technologies Inc	857		

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund,	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund,		Klasse WA (ausschüttend)	656
Klasse WA (ausschüttend)	684	FirstService Corporation	103
FirstService Corp	111	Colliers International Group Inc	86
Colliers International Group Inc	99	OBIC Business Consultants Co Ltd	72
Auktion Technology Group Plc	86	Dorman Products Inc	65
Valvoline Inc	70	New Work SE	61
Hirose Electric Co Ltd	61	Forward Air Corp	59
Miura Co Ltd	51	FormFactor Inc	50
Azelis Group NV	46	Brunswick Corp.DE	46
Fox Factory Holding Corp	46	Ralph Lauren Corp 'A'	45
Marlowe Plc	44	Inter Parfums Inc	43
Rogers Corp	37	RB Global Inc	42
MKS Instruments Inc	35	MKS Instruments Inc	40
TOTVS SA	35	LCI Industries	36
Haemonetics Corp	33	Avid Technology Inc	35
Lectra	33	Marel hf, 144A	33
Littelfuse Inc	31	Quaker Chemical Corp	33
New Work SE	31	UFP Industries Inc	33
JTC Plc, 144A	30	Douzone Bizon Co Ltd	29
NICE Information Service Co Ltd	27	Meitec Corp	27
Installed Building Products Inc	25	LKQ Corp	26
Cognex Corp	23	Marlowe Plc	26
Enpro Inc	22	VZ Holding AG	26
Esab Corp	22	Fox Factory Holding Corp	24
Restore Plc	21	Fukui Computer Holdings Inc	24
		Esab Corp	23
		Kadant Inc	23
		Gentex Corp	20

Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund,	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund,		Klasse WA (ausschüttend)	3.356
Klasse WA (ausschüttend)	3.356	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.262
NTPC Ltd	240	Samsung Electronics Co Ltd	1.191
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	174	Lite-On Technology Corp	464
		BHP Group Ltd	435
		PetroChina Co Ltd	411
		NHPC Ltd	393
		REC Ltd	387
		Rio Tinto Ltd	382
		China Construction Bank Corp	372
		McMillan Shakespeare Ltd	367
		Bank of China Ltd	366
		Uni-President Enterprises Corp	366
		Power Grid Corp of India Ltd	338
		Giordano International Ltd	335
		China Shenhua Energy Co Ltd	331
		Infosys Ltd	322
		PICC Property & Casualty Co Ltd	320
		Aurizon Holdings Ltd	304
		Coles Group Ltd	303
		Aboitiz Power Corp	301
		AIA Group Ltd	297

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] – (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Jardine Cycle & Carriage Ltd	295
Bank of Communications Co Ltd	293
Uni-President China Holdings Ltd	289
CITIC Telecom International Holdings Ltd	287
Indofood Sukses Makmur Tbk PT	287
Far East Horizon Ltd	280
Tisco Financial Group PCL, NVDR	277
Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	270
NTPC Ltd	267
Jardine Matheson Holdings Ltd	260
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	260
China Communications Services Corp Ltd	259
Orora Ltd	259
Stella International Holdings Ltd	259
Astra International Tbk PT	254

FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Innox Advanced Materials Co Ltd	35	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	302
LG Chem Ltd	30	Samsung Electronics Co Ltd	255
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	21	Tencent Holdings Ltd	238
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	17	HDFC Bank Limited	209
		AIA Group Limited	186
		LG Chem Ltd	170
		Alibaba Group Holding Limited	164
		United Overseas Bank Limited	156
		Singapore Telecommunications Ltd	153
		Ishares Core Msci Asia E-HKD	149
		Singapore Technologies Engineering Ltd	131
		Venture Corporation Limited	131
		Accton Technology Corporation	130
		ENN Energy Holdings Limited	117
		CSPC Pharmaceutical Group LTD	115
		Minth Group Ltd	112
		Hansol Chemical Co Ltd	103
		Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	97
		Ping An Insurance Group	94
		Techtronic Industries Company Limited	89
		Guangdong Investment Limited	86
		LG Energy Solution Ltd	84
		Tongcheng Travel Holdings Ltd	79
		Telkom Indonesia Persero Tbk	76
		TravelSky Technology Limited	76
		Shenzhen International Group Holdings Limited	63
		LEENO Industrial Inc	60
		JD.com, Inc	57
		TATA Consultancy Services Limited	53
		Innox Advanced Materials Co Ltd	43

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	28.851	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	27.231
Adyen NV, 144A	6.155	NVIDIA Corp	10.687
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	5.238	Adobe Inc	5.793
Mettler-Toledo International Inc	5.037	ANSYS Inc	4.598
Sartorius Stedim Biotech	4.479	AIA Group Ltd	4.417
Cadence Design Systems Inc	4.009	Microsoft Corp	4.255
Illumina Inc	3.756	ASML Holding NV	3.964
IDEXX Laboratories Inc	2.787	Linde Plc	3.688
Croda International Plc	2.504	Ferrari NV	3.253
CSL Ltd	1.467	Kerry Group Plc	3.252
Moncler SpA	974	Moncler SpA	3.054
NVIDIA Corp	874	L'Oreal SA	3.044
ASML Holding NV	834	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	3.003
Microsoft Corp	799	Atlas Copco AB	2.839
Linde Plc	697	Mastercard Inc	2.836
Pernod Ricard SA	690	Kingspan Group Plc	2.603
Kering SA	628	Masimo Corp	2.436
Ferrari NV	627	Coloplast A.S	2.206
L'Oreal SA	616	CSL Ltd	2.127
Atlas Copco AB	572	ResMed Inc	2.120
		Zoetis Inc	2.054
		Veeva Systems Inc 'A'	1.918
		NIKE Inc	1.844
		Pernod Ricard SA	1.841
		Assa Abloy AB	1.789
		Hexagon AB	1.777
		Croda International Plc	1.693

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ – (Fortsetzung)

		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.262	
Link REIT	706	
Indus Towers Ltd	647	
Wharf Real Estate Investment Co Ltd	620	
Aurizon Holdings Ltd	539	
Chorus Ltd	508	
CLP Holdings Ltd	433	
Guangdong Investment Ltd	388	
China Tower Corp Ltd, 144A	349	
GPT Group/The	348	
Vicinity Ltd	294	
Scentre Group	274	
Contact Energy Ltd	249	
APA Group	226	
Charter Hall Retail REIT	203	
Digital Telecommunications Infrastructure Fund	197	
Embassy Office Parks REIT	194	
AGL Energy Ltd	190	
NETLINK NBN TRUST	189	
Region RE Ltd	123	
Manila Electric Co	121	
Capitaland India Trust	109	
Transurban Group	93	
Westports Holdings Bhd	93	
Charter Hall Long Vale REIT	87	
WICHTIGSTE VERKÄUFE		
Autodesk Inc		1.689
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'		1.526
Illumina Inc		1.495
Kering SA		1.471
Mettler-Toledo International Inc		1.389
Adyen NV, 144A		1.260

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.262	
Link REIT	706	
Indus Towers Ltd	647	
Wharf Real Estate Investment Co Ltd	620	
Aurizon Holdings Ltd	539	
Chorus Ltd	508	
CLP Holdings Ltd	433	
Guangdong Investment Ltd	388	
China Tower Corp Ltd, 144A	349	
GPT Group/The	348	
Vicinity Ltd	294	
Scentre Group	274	
Contact Energy Ltd	249	
APA Group	226	
Charter Hall Retail REIT	203	
Digital Telecommunications Infrastructure Fund	197	
Embassy Office Parks REIT	194	
AGL Energy Ltd	190	
NETLINK NBN TRUST	189	
Region RE Ltd	123	
Manila Electric Co	121	
Capitaland India Trust	109	
Transurban Group	93	
Westports Holdings Bhd	93	
Charter Hall Long Vale REIT	87	
WICHTIGSTE VERKÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		1.119
AGL Energy Ltd		872
NHPC Ltd		848
Power Grid Corp of India Ltd		813
Indus Towers Ltd		734
CLP Holdings Ltd		730
Transurban Group		622
Capitaland Integrated Commercial Trust		578
Contact Energy Ltd		497
Link REIT		441
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd		402
Region RE Ltd		398
Vicinity Ltd		394
Charter Hall Retail REIT		386
China Tower Corp Ltd, 144A		319
Scentre Group		312
GPT Group/The		279
Chorus Ltd		239
NETLINK NBN TRUST		211
China Merchants Port Holdings Co Ltd		208
Guangdong Investment Ltd		184
Aurizon Holdings Ltd		178
Embassy Office Parks REIT		165
Charter Hall Long Vale REIT		159
Fortune Real Estate Investment Trust		143

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.877	
HDFC Bank Ltd	575	
Tata Consultancy Services Ltd	492	
MercadoLibre Inc	397	
Capitec Bank Holdings Ltd	319	
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	314	
Globant SA	304	
Proya Cosmetics Co., Ltd	250	
Tencent Holdings Ltd	223	
Dr. Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	209	
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	197	
Minth Group Ltd	196	
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co.,Ltd.	153	
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	146	
China Merchants Bank Co Ltd	112	
Samsung Electronics Co Ltd	112	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	111	
SK Hynix Inc	48	
Alibaba Group Holding Ltd	38	
ICICI Bank Ltd	36	
WICHTIGSTE VERKÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		5.457
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd		1.005
Samsung Electronics Co Ltd		583
ICICI Bank Ltd		559
Tencent Holdings Ltd		401
Titan Co Ltd		343
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT		317
SK Hynix Inc		294
Ping An Bank Co Ltd		280
WEG SA		252
EPAM Systems Inc		223
ENN Energy Holdings Ltd		219
Credicorp Ltd		217
HDFC Bank Ltd		215
Globalwafers Co Ltd		196
AIA Group Ltd		195
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao		166
Reliance Industries Ltd		165
Alibaba Group Holding Ltd ADR		162
Meituan 'B', 144A		119

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGSTE KÄUFE		
Adyen NV, 144A	7.807	
BE Semiconductor Industries NV	4.442	
Croda International Plc	3.799	
Sartorius Stedim Biotech	2.714	
Moncler SpA	2.468	
ASML Holding NV	1.175	
L'Oreal SA	915	
Linde Plc	861	
Mettler-Toledo International Inc	774	
Assa Abloy AB	759	
Hexagon AB	713	
Kingspan Group Plc	702	
Nemetschek SE	698	
Atlas Copco AB	696	
Kering SA	641	
Coloplast A.S	627	
WICHTIGSTE VERKÄUFE		
Ferrari NV		9.544
ASML Holding NV		7.336
Infineon Technologies AG		6.089
Kerry Group Plc		5.337
Mettler-Toledo International Inc		3.709
Allfunds Group Plc		3.283
Atlas Copco AB		3.029
Assa Abloy AB		2.329
Moncler SpA		2.293
Dassault Systemes SE		2.203
L'Oreal SA		1.983
Linde Plc		1.916
Kingspan Group Plc		1.662
Nemetschek SE		1.549
Partners Group Holding AG		1.497
Sartorius Stedim Biotech		1.451

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Partners Group Holding AG	619	Hexagon AB	1.425
Ferrari NV	618	Kering SA	1.345
Dassault Systemes SE	596	Coloplast A.S	1.327
Pernod Ricard SA	471	Dr Martens Plc	1.295
Infineon Technologies AG	391	Croda International Plc	1.142
Oxford Nanopore Technologies Plc	340	Adyen NV, 144A	1.005
		Pernod Ricard SA	993
		BE Semiconductor Industries NV	970
		Oxford Nanopore Technologies Plc	719

FTGF Martin Currie Improving Society Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Intuitive Surgical Inc	390	Ecolab Inc	69
Xylem Inc.NY	373	Verra Mobility Corp 'A'	35
HDFC Bank Ltd ADR	365		
Revvity Inc	333		
Valmont Industries Inc	322		
Ecolab Inc	309		
Novozymes A.S	308		
Croda International Plc	305		
Illumina Inc	305		
Veolia Environnement SA	296		
Amplifon SpA	287		
Airtel Africa Plc, 144A	275		
Deere & Co	266		
MercadoLibre Inc	258		
Veeva Systems Inc 'A'	255		
Masimo Corp	254		
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	185		
Vistry Group Plc	142		
Energy Recovery Inc	124		
MIPS AB	122		
Verra Mobility Corp 'A'	122		
Emirates Central Cooling Systems Corp	111		
Planet Fitness Inc 'A'	101		
Coursera Inc	86		
FDM Group Holdings Plc	78		
Everbridge Inc	71		
Stride Inc	68		
LITALICO Inc	62		

Franklin Responsible Income 2028 Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Logicor Financing Sarl, 4,625 %, fällig am 25.07.2028	1.500	Teleperformance SE, 0,250 %, fällig am 26.11.2027	1.333
ING Groep NV, 4,875 %, fällig am 14.11.2027	1.317	Tele2 AB, 2,125 %, fällig am 15.05.2028	1.322
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375 %, fällig am 21.06.2028	1.313	Werfen SA/Spain, 4,625 %, fällig am 06.06.2028	1.290
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500 %, fällig am 01.03.2028	1.309	HSBC Holdings PLC, 4,752 %, fällig am 10.03.2028	1.231
Schneider Electric SE, 1,500 %, fällig am 15.01.2028	1.297	International Business Machines Corp, 0,300 %, fällig am 11.02.2028	1.130
Abertis Infraestructuras SA, 4,125 %, fällig am 31.01.2028	1.296	Banco Santander SA, 3,875 %, fällig am 17.03.2028	1.091
Telenor ASA, 0,250 %, fällig am 14.02.2028	1.295	UBS Group AG, 4,625 %, fällig am 17.03.2028	999
BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig am 19.02.2028	1.294	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, fällig am 04.05.2028	935
UBS Group AG, 4,625 %, fällig am 17.03.2028	1.293	TenneT Holding BV, 1,375 %, fällig am 05.06.2028	928
Werfen SA/Spain, 4,625 %, fällig am 06.06.2028	1.290	Thames Water Utilities Finance Plc, 0,875 %, fällig am 31.01.2028	924
Werfen SA/Spain, 4,625 %, fällig am 06.06.2028	1.290	Vonovia Finance BV, 1,500 %, fällig am 14.01.2028	768
Tele2 AB, 2,125 %, fällig am 15.05.2028	1.286	Abanca Corp Bancaria SA, 5,250 %, fällig am 14.09.2028	689
Teleperformance SE, 0,250 %, fällig am 26.11.2027	1.284	UBS Group AG, 0,650 %, fällig am 14.01.2028	630
TenneT Holding BV, 1,375 %, fällig am 05.06.2028	1.280	Autostrade per l'Italia SpA, 2,000 %, fällig am 04.12.2028	545
NTT Finance Corp, 0,399 %, fällig am 13.12.2028	1.270	United Group BV, 4,625 %, fällig am 15.08.2028	515
Motability Operations Group Plc, 0,125 %, fällig am 20.07.2028	1.264	Apple Inc, 2,000 %, fällig am 17.09.2027	477
Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625 %, fällig am 27.11.2027	1.255	Schneider Electric SE, 1,500 %, fällig am 15.01.2028	461
H Lundbeck A.S, 0,875 %, fällig am 14.10.2027	1.223	NTT Finance Corp, 0,399 %, fällig am 13.12.2028	437
Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig am 27.01.2028	1.217	Eurobank SA, 2,250 %, fällig am 14.03.2028	425
HSBC Holdings PLC, 4,725 %, fällig am 10.03.2028	1.202	Kleopatra Finco Sarl, 4,250 %, fällig am 01.03.2026	412
TDF Infrastructure SASU, 5,625 %, fällig am 21.07.2028	1.198	NatWest Markets Plc, 1,375 %, fällig am 02.03.2027	371
LKQ European Holdings BV, 4,125 %, fällig am 01.04.2028	1.183	Cloverie Plc für Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig am 15.12.2028	369
Credit Agricole SA, 0,375 %, fällig am 20.04.2028	1.168	SANEF SA, 0,950 %, fällig am 19.10.2028	359
ALD SA, 3,875 %, fällig am 24.01.2028	1.099	SBB Treasury Oyj, 0,750 %, fällig am 14.12.2028	241
Verizon Communications Inc, 1,375 %, fällig am 02.11.2028	1.073	Matterhorn Telecom SA, 4,000 %, fällig am 15.11.2027	232
UBS Group AG, 4,625 %, fällig am 17.03.2028	1.001	RCI Banque SA, 4,875 %, fällig am 21.09.2028	208
Crown European Holdings SA, 5,000 %, fällig am 15.05.2028	1.000		
Danske Bank A/S, 4,500 %, fällig am 09.11.2028	999		
Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, fällig am 25.08.2028	974		
Rumänien, internationale Staatsanleihe, 2,125 %, fällig am 07.03.2028	947		
Deutsche Lufthansa AG, 3,750 %, fällig am 11.02.2028	919		
Azelis Finance NV, 5,750 %, fällig am 15.03.2028	908		
Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, fällig am 16.07.2028	904		
Cloverie Plc für Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig am 15.12.2028	881		
Volvo Car AB, 4,250 %, fällig am 31.05.2028	855		
Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, fällig am 01.11.2027	798		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Franklin Responsible Income 2028 Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD
DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, fällig am 15.09.2027	793
Societe Generale SA, 0,125 %, fällig am 18.02.2028	764
National Grid Plc, 0,163 %, fällig am 20.01.2028	760
Macquarie Group Ltd, 0,350 %, fällig am 03.03.2028	744
PVH Corp, 3,125 %, fällig am 15.12.2027	727
OP Corporate Bank plc, 0,375 %, fällig am 16.06.2028	667

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Vergütungspolitik gemäß OGAW-V (ungeprüft)

Vergütung

Franklin Templeton International Services S.à.r.l. („FTIS“), eine für OGAW zugelassene Verwaltungsgesellschaft (die „Verwaltungsgesellschaft“), wendet eine Vergütungsrichtlinie (die „Richtlinie“) an, die für alle von ihr verwalteten OGAW-Fonds (jeweils ein „OGAW“ und gemeinsam die „OGAW“) gilt. Die Richtlinie ist darauf ausgerichtet, das Eingehen übermäßiger Risiken zu verhindern. Die entsprechenden Performance-Managementsysteme umfassen Risikokriterien, die für die hiervon abgedeckten Geschäftsbereiche spezifisch sind. Die Governance-Struktur der Richtlinie zielt darauf ab, interne Interessenkonflikte zu verhindern.

Es wurden feste Verfahren für die Erstellung, Aktualisierung, Überprüfung und Genehmigung der Richtlinien sowie für die Kommunikation und Umsetzung der Richtlinien eingeführt. Sowohl die Geschäftsleitung als auch die Personalabteilung, die Compliance-Beauftragten und andere Abteilungen sind in dieses Verfahren eingebunden. Die Richtlinie wird von der Geschäftsführung und vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft genehmigt.

Die feste Vergütung ist definiert als Grundgehalt zuzüglich sonstiger Leistungen, zu denen Pensionsbeiträge, Lebensversicherungsprämien oder Beiträge zur privaten Krankenversicherung zählen können. Die Höhe der festen Vergütung richtet sich nach der Komplexität der Tätigkeit, dem Verantwortungsniveau, der jeweiligen Leistung und der am Markt ermittelten Vergleichsdaten. Sie wird regelmäßig überprüft.

Die variable Vergütung ist definiert als jährliche Boni, langfristige Zusagen in Form von gewährten Performance-Anteilen oder Vertriebsbonuszahlungen. Die Höhe der variablen Vergütung richtet sich nach dem Gesamtergebnis des Unternehmens und des Geschäftsbereichs sowie nach der individuellen Leistung.

Die vollständige Richtlinie ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich. Quantitative Informationen, die für die Fonds relevant sind, sind nachfolgend aufgeführt:

Gesamtbetrag der festen Vergütung, die von FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2023 gezahlt wurde*, **, ***	11.355.206 €
Gesamtbetrag der variablen Vergütung, die von FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2023 gezahlt wurde*, **, ***	9.207.100 €
Anzahl der Mitarbeiter von FTIS und seinen Beauftragten zum 30. September 2023	601
Gesamtbetrag der Vergütung, die FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2023 an die Geschäftsleitung gezahlt haben*, **, ***	5.755.423 €
Von FTIS und seinen Beauftragten an andere Mitarbeiter, die während des Geschäftsjahres zum 30. September 2023 erheblichen Einfluss auf das OGAW-Profil hatten, gezahlter Gesamtbetrag*, **, ***	– €

* Der Gesamtbetrag der von FTIS gezahlten Vergütung wurde jedem OGAW auf der Grundlage ihres anteiligen Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen von FTIS am Monatsende für das am 30. September 2023 zu Ende gegangene Jahr zugewiesen.

** Der Gesamtbetrag der von den Beauftragten von FTIS gezahlten Vergütung wurde jedem OGAW auf der Grundlage ihres anteiligen Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen von den Beauftragten von FTIS am Monatsende für das am 30. September 2023 zu Ende gegangene Jahr zugewiesen.

*** Bei den Beauftragten handelt es sich um Anlageverwaltungsgesellschaften, die aufsichtsrechtlichen Anforderungen unterliegen, die ebenso wirksam sind wie die des Artikels 69(3)(a) der OGAW-Richtlinie.

Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung) (ungeprüft)

In den folgenden Tabellen sind der Bruttogesamtnennwert für Reverse-Repo-Geschäfte sowie der absolute Marktwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Kontrahenten, zum 29. Februar 2024 aufgeführt:

Reverse-Repo-Geschäfte

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Gegenpartei	Gründungsland	Summe Brutto-Nominalwert (in Tsd.) USD	Absoluter beizulegender Zeitwert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	70.000	70.000	6,28
HSBC Bank (USA)	Vereinigtes Königreich	55.000	55.000	4,94
JP Morgan Securities LLC	USA	95.000	95.000	8,52
Royal Bank of Canada	Kanada	50.000	50.000	4,49
TD Securities (USA) LLC	Kanada	39.597	39.597	3,55
		309.597	309.597	27,78

In der folgenden Tabelle sind die zehn größten Emittenten von Sicherheiten aufgeführt, basierend auf dem Wert der erhaltenen unbaren Sicherheiten und der Währung der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 29. Februar 2024:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	USA***	US-Dollar	315.822 \$

* Sofern es zum 29. Februar 2024 weniger als zehn Emittenten von Sicherheiten gab, wurden alle Emittenten einbezogen.

** Die zugrundeliegende Anleihe, die als Sicherheit gehalten wird, wird vom United States Treasury ausgegeben.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art und Qualität der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 29. Februar 2024:

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen	Investment Grade	315.822 \$

Die nachstehende Laufzeitanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der Reverse-Repo-Geschäfte und den damit verbundenen erhaltenen.(bereitgestellten) Sicherheiten zum 29. Februar 2024:

Fonds	Art des Derivats.der Sicherheit	Weniger als 1 Tag (in Tsd.)	1 Tag bis 1 Woche (in Tsd.)	1 Woche bis 1 Monat (in Tsd.)	1 Monat bis 3 Monate (in Tsd.)	3 Monate bis 1 Jahr (in Tsd.)	Über 1 Jahr (in Tsd.)	Ohne Fälligkeitsdatum (in Tsd.)	Gesamt (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Reverse-Repo-Geschäfte	–	309.597 \$	–	–	–	–	–	309.597 \$
	Erhaltene unbare Sicherheiten	–	–	749 \$	33.004 \$	31.100 \$	250.969 \$	–	315.822 \$

Bei den Reverse-Repo-Geschäften, die für den Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund gehalten werden, handelt es sich um Dreiparteienverträge. Vom Fonds im Zusammenhang mit den zum 29. Februar 2024 offenen Reverse-Repo-Geschäften vereinnahmte Sicherheiten werden bei der Bank of New York Mellon auf getrennten Konten im Namen der Gesellschaft gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

Alle Kosten und Renditen aus Reverse-Repo-Geschäften laufen in voller Höhe für den Fonds auf.

Anhang: Offenlegung von Geschäften mit verbundenen Personen (ungeprüft)

In dem am 29. Februar 2024 endenden Geschäftsjahr erbrachte Pershing Limited, eine Tochtergesellschaft von The Bank of New York Mellon Corporation und eine verbundene Person der Verwahrstelle, Brokerage-Dienstleistungen in Bezug auf den Wertpapierhandel mit den in Hongkong registrierten Fonds, der über die Untereinlageverwalter der jeweiligen Fonds abgewickelt wird. Der Gesamtwert der Geschäfte mit den mit der Verwahrstelle verbundenen Personen in Bezug auf den Wertpapierhandel belief sich auf 365 Mio. USD, was 0,19 % des Gesamtwerts der von diesen Fonds abgeschlossenen Transaktionen entspricht. Die von den Fonds an Pershing Limited gezahlten Maklergebühren und -provisionen im Zusammenhang mit diesem Wertpapierhandel beliefen sich für das am 29. Februar 2024 endende Geschäftsjahr auf 63.130 USD bei einem durchschnittlichen Provisionssatz von 2 Basispunkten. Diese sind in den Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe relevanter Wertpapiere enthalten und in Erläuterung 4 dieses Abschlusses ausgewiesen.

In dem am 29. Februar 2024 endenden Geschäftsjahr handelten The Bank of New York Mellon (Institutional Bank) und The Bank of New York Mellon SA/NV, beide verbundene Personen der Verwahrstelle, im Rahmen von Devisengeschäften bzw. Währungsmanagement-/Absicherungsprogrammen für die in Hongkong registrierten Fonds. Die im Zusammenhang mit diesen Geschäften gezahlten Provisionen beliefen sich auf 1.024.021 USD bei einem durchschnittlichen Provisionssatz von 0,22 Basispunkten. Der Gesamtwert der diesbezüglichen Geschäfte mit den mit der Verwahrstelle verbundenen Personen belief sich auf 45.706 Mio. USD, was 1,89 % des Gesamtwerts der von den Fonds abgeschlossenen Geschäfte entspricht.

Alle Geschäfte mit den verbundenen Personen der Verwahrstelle wurden im ordentlichen Geschäftsgang und zu marktüblichen Bedingungen geschlossen.

Anhang: Sustainability Finance Disclosure Regulation (ungeprüft)

Die Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) (die „SFDR“) schreibt vor, dass die Gesellschaft in ihre regelmäßigen Berichte eine Beschreibung aufnehmen muss, inwieweit jeder nach Artikel 8 SFDR (ein „Artikel-8-Fonds“) oder Artikel 9 SFDR (ein „Artikel-9-Fonds“) eingestufte Fonds seinen ökologischen oder sozialen Merkmalen gerecht wurde. Gemäß SFDR sind zudem die Europäische Bankenaufsicht, die Europäische Aufsichtsbehörde für das Versicherungswesen und die betriebliche Altersversorgung und die Europäische Wertpapieraufsichtsbehörde (zusammen die „europäischen Aufsichtsbehörden“) befugt, Entwürfe für technische Regulierungsstandards („RTS“) auszuarbeiten, die Inhalt und Format der Informationen für die regelmäßigen Berichte vorgeben.

Der folgende Anhang, der die nach der SFDR vorgeschriebenen Angaben für jeden Artikel-8- und Artikel-9-Fonds enthält, wurde unter Anwendung der einheitlichen Vorgaben für Nachhaltigkeitsangaben bzw. die diesbezügliche Berichterstattung gemäß den RTS erstellt. Diese Vorgaben traten am 1. Januar 2023 in Kraft. Die Klassifizierungen der Anlagen in den folgenden Angaben basieren auf dem MSCI und können sich von der Klassifizierung der Wertpapiere im Anlagenportfolio unterscheiden.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300WRHLJECFCSP797



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 3,55% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - o THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - o Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - o Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 29. Februar 2024 bei 3,55 %.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	109,18	64,62%	121,00	95,90%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	203,33	100,00%	235,40	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	65,42%	0,00%	95,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	65,42%	0,00%	95,00%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht, im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen wesentliche ökologische und/oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten, darunter auch Screening-Tools, Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das sämtliche obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den UNGC-Grundsätzen und den OECD-Leitsätzen auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die nachstehend aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	109,18	64,62%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	203,33	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	65,42%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	65,42%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Federal National Mortgage Association	Finanzsektor	15,48%	USA
United States of America	Staatsanleihen	14,97%	USA
Government National Mortgage Association	Finanzsektor	9,83%	USA
Freddie Mac	Finanzsektor	9,66%	USA
FRANKLIN RESOURCES, INC.	Finanzsektor	4,17%	USA
UBS Group AG	Finanzsektor	2,08%	USA
BANK OF AMERICA CORPORATION	Finanzsektor	1,93%	USA
WELLS FARGO & COMPANY	Finanzsektor	1,77%	USA
CITIGROUP INC.	Finanzsektor	1,59%	USA
THE GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	Finanzsektor	1,48%	USA
MORGAN STANLEY	Finanzsektor	1,16%	USA
JPMORGAN CHASE & CO.	Finanzsektor	1,12%	USA
VERIZON COMMUNICATIONS INC.	Kommunikationsdienste	0,80%	USA
Estados Unidos Mexicanos	Staatsanleihen	0,79%	Mexiko
RITHM CAPITAL CORP.	Finanzsektor	0,74%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

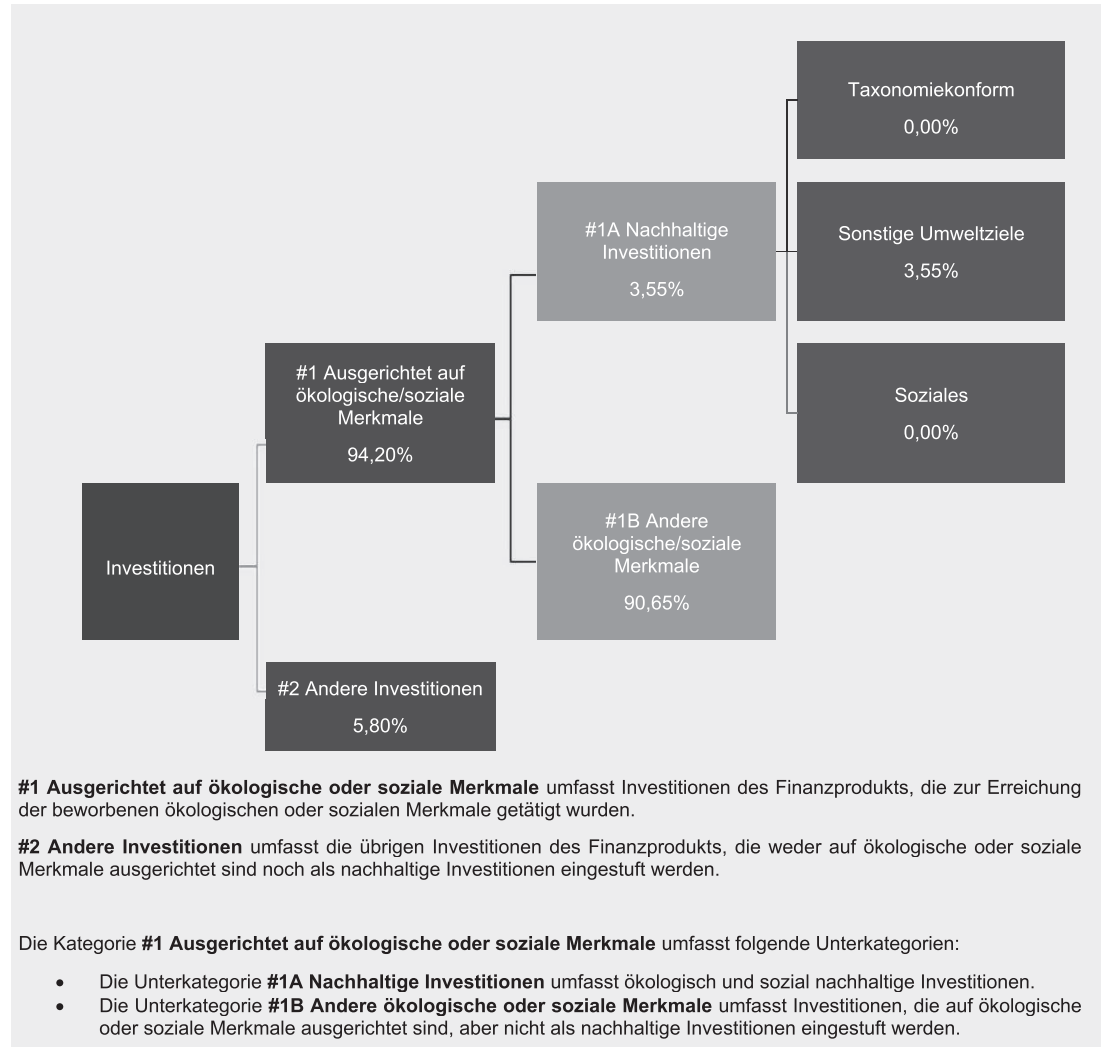
Zum 29. Februar 2024 lag der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen bei 3,55 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Zum 29. Februar 2024 waren 94,20 % des Fonds auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (5,80 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 3,55 % seines Vermögens in nachhaltige Anlagen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	55,16%
Staatsanleihen	26,97%
Energie	4,16%
Kommunikationsdienste	3,40%
Gesundheitssektor	2,66%
Zyklische Konsumgüter	1,85%
Grundstoffe	1,57%
Informationstechnologie	1,56%
Industrie	1,14%
Basiskonsumgüter	0,88%
Versorgungsunternehmen	0,84%
Immobilien	0,37%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	42,98%
Staatsanleihen	26,97%
Banken	8,75%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	3,93%
Kapitalmärkte	2,41%
Medien	1,39%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,28%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,27%
Metalle u. Bergbau	0,88%
Allgemeiner Einzelhandel	0,83%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	0,76%
Biotechnologie	0,67%
Papier u. Forstprodukte	0,53%
Pharmaindustrie	0,53%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	0,51%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

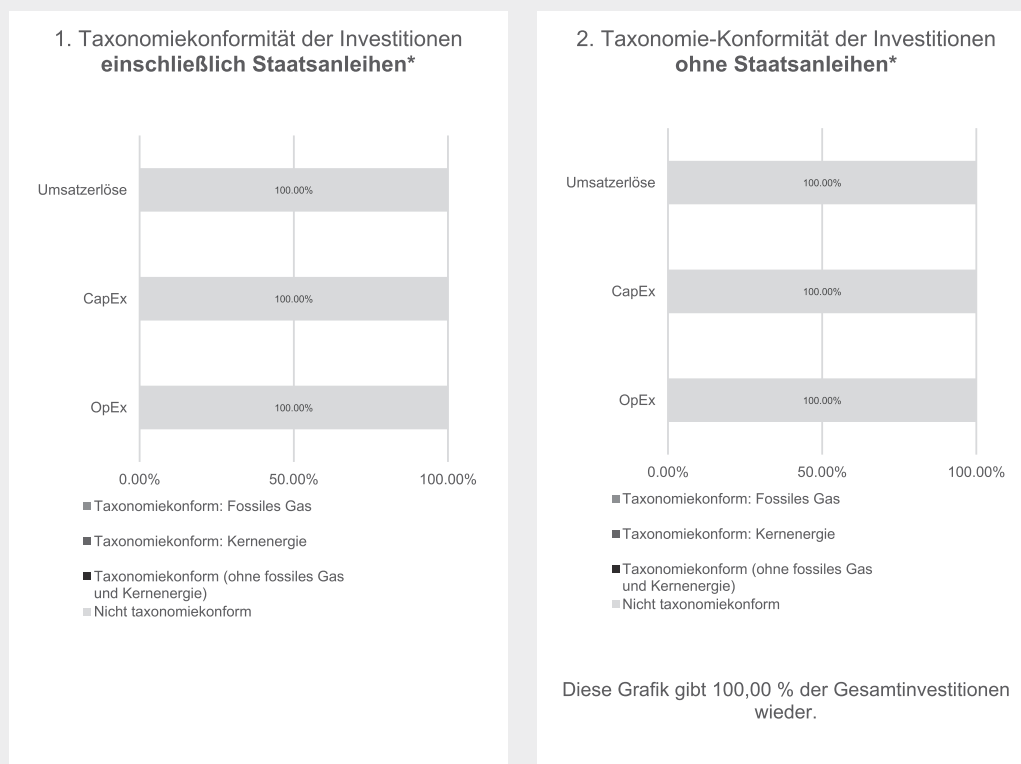
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 (17) SFDR, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds zum 29. Februar 2024 3,55 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 29. Februar 2024 betrug der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen 5,80 % und umfasste liquide Mittel und Derivate oder andere Emittenten ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung finanziell wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.
- D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:
 - a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
 - b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.
 - c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).
 - d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 3,55 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von A.
- B. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 63,6 % der Benchmark.
- C. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 28,3 % ggü. 20,7 % der Benchmark.
- D. Der Fonds hatte zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 3,55 % in nachhaltige Anlagen investiert.
- E. Gemäß den Definitionen von Western Asset für UNGC hatte der Fonds keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder

Nicht zutreffend

sozialen Merkmale
erreicht.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
472PNIHDHJOEBNUD0P21



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 3,68% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - o THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - o Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - o Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 29. Februar 2024 bei 3,68 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	151,54	72,43%	149,90	93,20%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	183,19	100,00%	232,10	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	72,48%	0,00%	92,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	72,52%	0,00%	92,00%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht, im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen wesentliche ökologische und/oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten, darunter auch Screening-Tools, Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendet die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entspricht.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das sämtliche obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den UNGC-Grundsätzen und den OECD-Leitsätzen auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die nachstehend aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	151,54	72,43%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	183,19	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	72,48%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	72,52%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Federal National Mortgage Association	Finanzsektor	15,25%	USA
Government National Mortgage Association	Finanzsektor	9,97%	USA
Freddie Mac	Finanzsektor	9,72%	USA
United States of America	Staatsanleihen	6,49%	USA
Estados Unidos Mexicanos	Staatsanleihen	3,74%	Mexiko
UBS Group AG	Finanzsektor	2,22%	USA
CITIGROUP INC.	Finanzsektor	2,16%	USA
BANK OF AMERICA CORPORATION	Finanzsektor	2,04%	USA
WELLS FARGO & COMPANY	Finanzsektor	1,87%	USA
THE GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	Finanzsektor	1,82%	USA
JPMORGAN CHASE & CO.	Finanzsektor	1,15%	USA
BNP PARIBAS SA	Finanzen	1,01%	Frankreich
Republica Federativa do Brasil	Staatsanleihen	0,90%	Brasilien
VERIZON COMMUNICATIONS INC.	Kommunikationsdienste	0,81%	USA
ABBVIE INC.	Gesundheitssektor	0,69%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

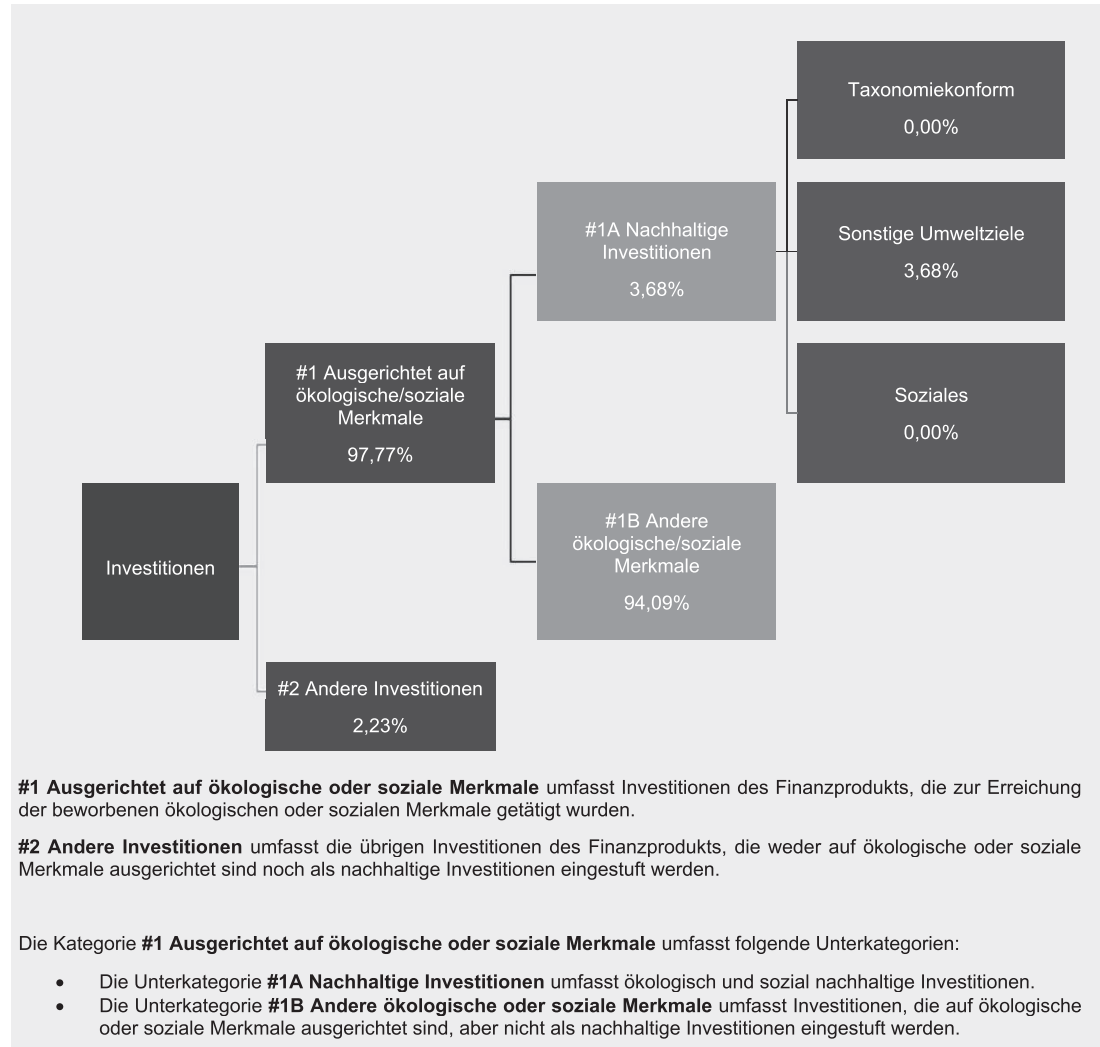
Zum 29. Februar 2024 lag der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen bei 3,68 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Zum 29. Februar 2024 waren 97,77 % des Fonds auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,23 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorrangig aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Fondsportfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 3,68 % seines Vermögens in nachhaltige Anlagen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	55,16%
Staatsanleihen	26,97%
Energie	4,16%
Kommunikationsdienste	3,40%
Gesundheitssektor	2,66%
Zyklische Konsumgüter	1,85%
Grundstoffe	1,57%
Informationstechnologie	1,56%
Industrie	1,14%
Basiskonsumgüter	0,88%
Versorgungsunternehmen	0,84%
Immobilien	0,37%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	38,25%
Staatsanleihen	22,62%
Banken	9,22%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	4,89%
Kapitalmärkte	3,17%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,93%
Medien	1,75%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,35%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	1,19%
Pharmaindustrie	0,97%
Allgemeiner Einzelhandel	0,83%
Biotechnologie	0,73%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	0,66%
Kundenkreditgeschäft	0,64%
Getränke	0,61%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

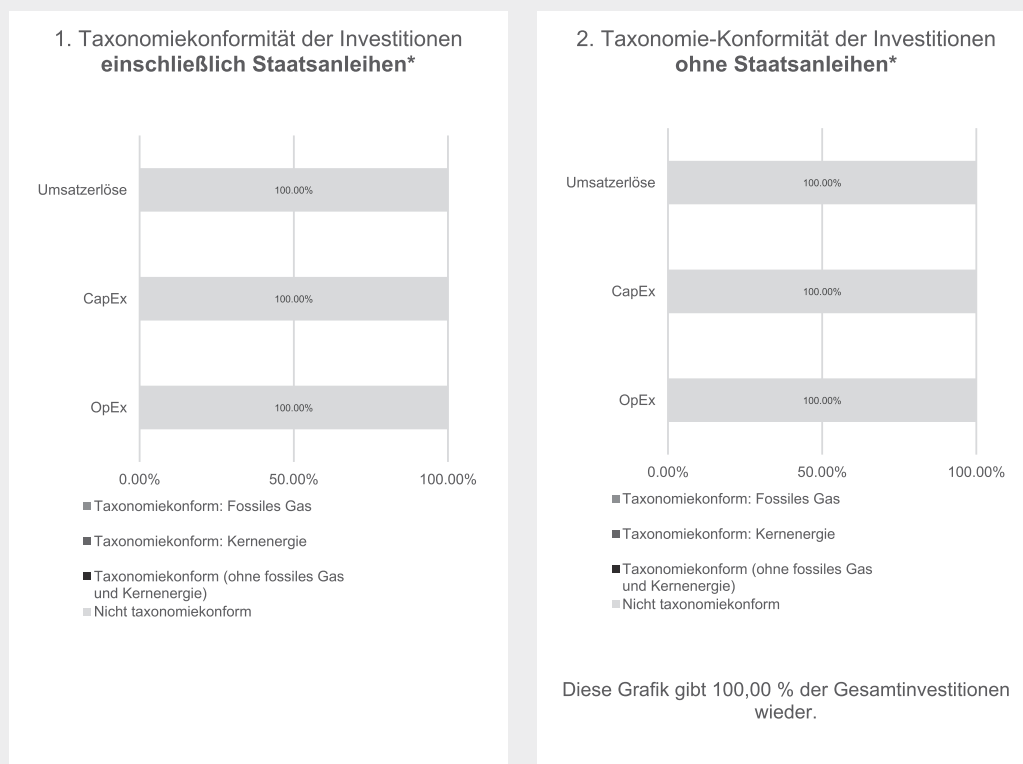
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 (17) SFDR, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds zum 29. Februar 2024 3,68 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug zum 29. Februar 2024 2,23 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.
- D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:
 - a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
 - b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.
 - c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).
 - d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 3,68 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von A.
- B. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 63,5 % der Benchmark.
- C. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 30,2 % ggü. 20,7 % der Benchmark.
- D. Der Fonds hatte zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 3,68 % in nachhaltige Anlagen investiert.
- E. Gemäß den Definitionen von Western Asset für UNGC hatte der Fonds keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder

sozialen Merkmale
erreicht.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493004ZO0T2R3JB1A61



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 4,39% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - o THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - o Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - o Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 29. Februar 2024 bei 4,39 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	152,74	48,45%	184,30	80,40%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	211,94	100,00%	245,00	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	50,04%	0,00%	83,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	50,04%	0,00%	83,00%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht, im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keine erheblichen Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozial nachhaltigen Anlageziele verursachten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten, darunter auch Screening-Tools, Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das sämtliche obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den UNGC-Grundsätzen und den OECD-Leitsätzen auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die nachstehend aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	152,74	48,45%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	211,94	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	50,04%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	50,04%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
United States of America	Staatsanleihen	19,25%	USA
Pemerintah Republik Indonesia	Staatsanleihen	2,41%	Indonesien
Rzeczpospolita Polska	Staatsanleihen	1,76%	Polen
Republic of South Africa	Staatsanleihen	1,59%	Südafrika
FRANKLIN RESOURCES, INC.	Finanzsektor	1,35%	USA
Republica Federativa do Brasil	Staatsanleihen	1,23%	Brasilien
FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC	Finanzsektor	1,14%	USA
UBS Group AG	Finanzsektor	1,10%	USA
WELLS FARGO & COMPANY	Finanzsektor	0,94%	USA
SPRINT CAPITAL CORPORATION	Kommunikationsdienste	0,87%	USA
JPMORGAN CHASE & CO.	Finanzsektor	0,83%	USA
TESCO PLC	Finanzsektor	0,77%	Vereinigtes Königreich
RANGE RESOURCES CORPORATION	Energie	0,75%	USA
UNITED RENTALS (NORTH AMERICA), INC.	Industrie	0,73%	USA
LLOYDS BANKING GROUP PLC	Finanzsektor	0,72%	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

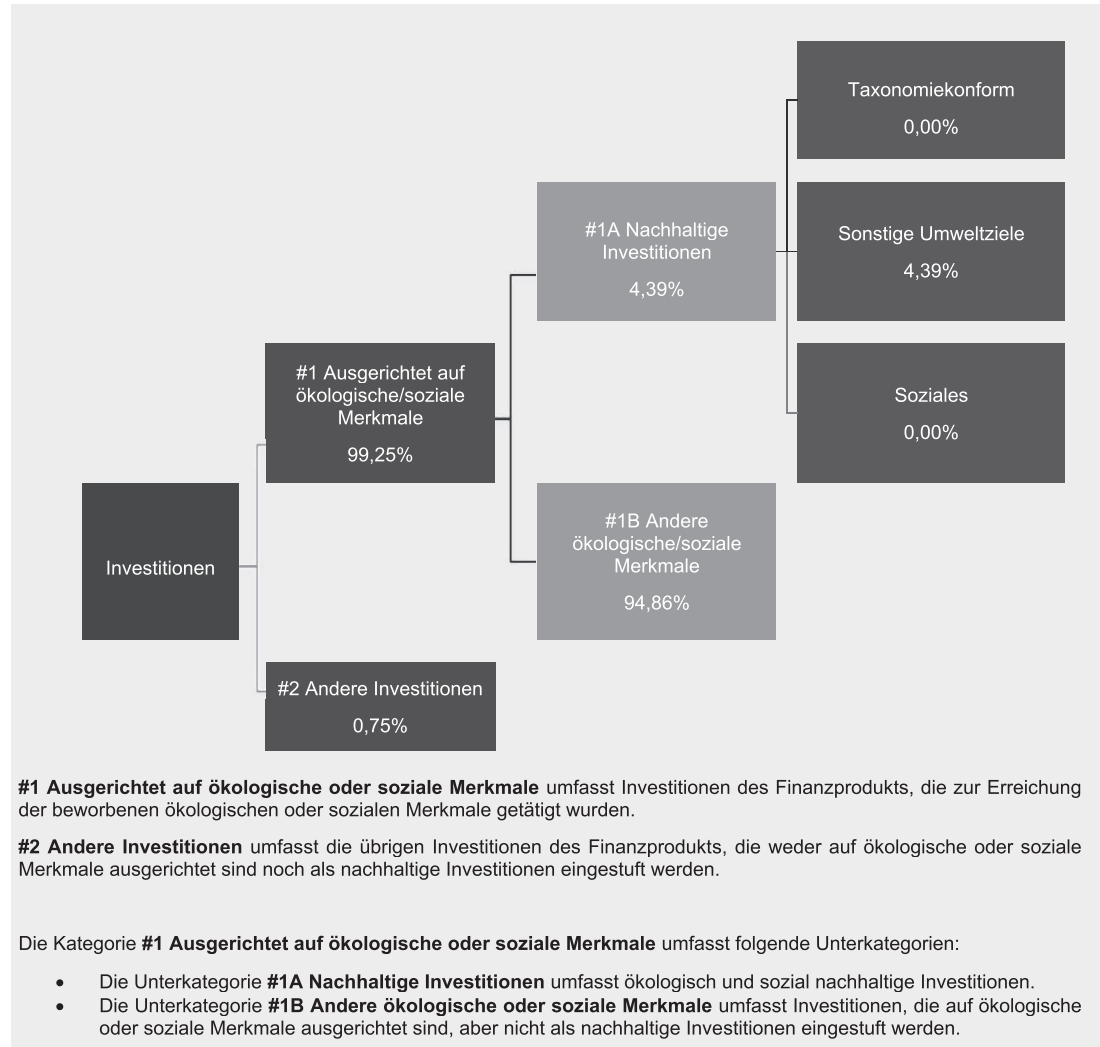
Zum 29. Februar 2024 lag der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen bei 4,39 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Zum 29. Februar 2024 waren 99,25 % des Fonds auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,75 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorrangig aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 4,39 % seines Vermögens in nachhaltige Anlagen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	34,84%
Finanzsektor	24,20%
Kommunikationsdienste	7,29%
Energie	7,06%
Industrie	5,17%
Zyklische Konsumgüter	5,02%
Grundstoffe	3,52%
Gesundheitssektor	2,43%
Immobilien	1,43%
Informationstechnologie	1,19%
Basiskonsumgüter	0,91%
Versorgungsunternehmen	0,10%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	34,84%
Banken	9,42%
Finanzdienstleistungen	8,92%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	5,99%
Medien	3,28%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	3,09%
Kapitalmärkte	2,50%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,95%
Versicherungen	1,74%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	1,60%
Passagierfluggesellschaften	1,57%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	1,52%
Kundenkreditgeschäft	1,52%
Container und Verpackungen	1,27%
Pharmaindustrie	1,15%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

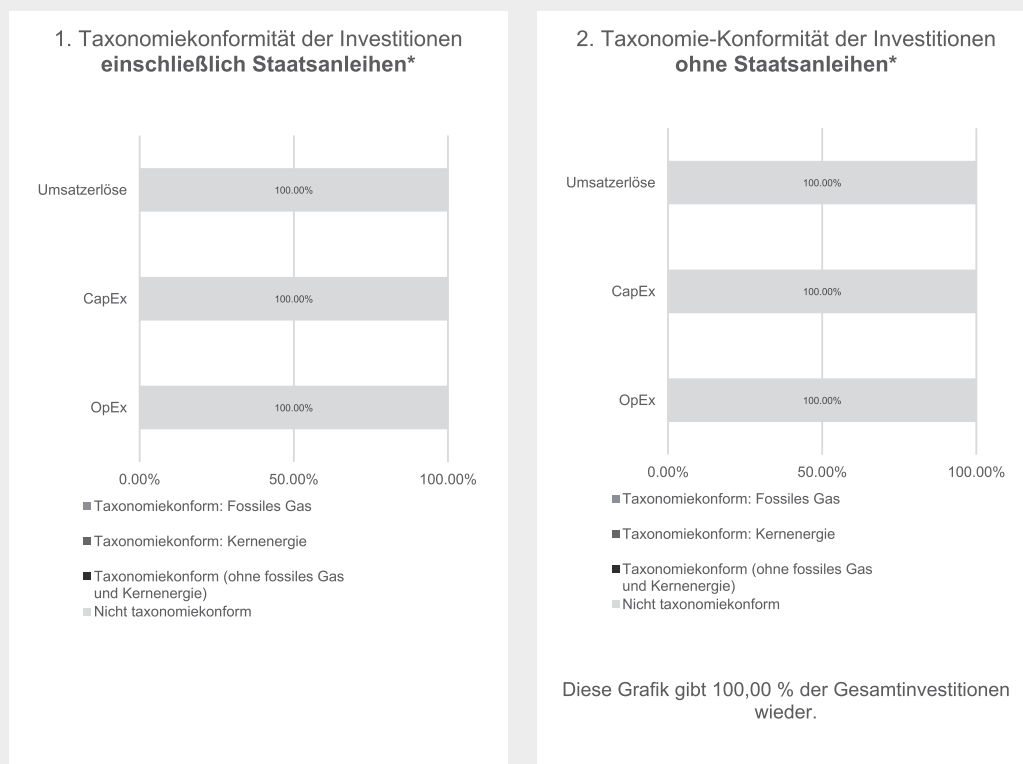
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 (17) SFDR, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds zum 29. Februar 2024 4,39 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 29. Februar 2024 betrug der Anteil von Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ 0,75 % und liquide Mittel und Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.
- Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.
- Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:
 - Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
 - Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.
 - Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).
 - Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 4,39 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von BBB.
- Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 74,9 % der Benchmark.
- Die Zuordnung des Fonds zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 28,8 %.
- Gemäß den Definitionen von Western Asset für UNGC hatte der Fonds keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder

Nicht zutreffend

sozialen Merkmale
erreicht.

FTGF Western Asset US High Yield Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493005YY2WWWVLYH2080



**FRANKLIN
TEMPLETON**

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 3,08% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - o THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - o THG-Intensität (PAI Nr. 10)
 - o Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14), und
 - o Länder, in denen investiert wird, und die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 29. Februar 2024 bei 3,08 %.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	189,05	75,09%	230,20	72,90%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	166,84	100,00%	175,30	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	73,78%	0,00%	73,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	73,78%	0,00%	73,00%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	100,00%	0,00	100,00%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht, im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keine erheblichen Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozial nachhaltigen Anlageziele verursachten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten, darunter auch Screening-Tools, Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das sämtliche obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Konkret kamen die folgenden PAI-Indikatoren zur Anwendung: PAI Nr. 3 für die THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten; Ausschlüsse auf der Grundlage von PAI Nr. 10 für Emittenten, die die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze nicht einhalten; PAI Nr. 14 für Emittenten im gesamten Fonds (gegenüber denjenigen im investierbaren Anlageuniversum), die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen; und PAI Nr. 16 für Länder, in die investiert wird und die von Freedom House nicht als frei bezeichnet werden.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt den Referenzindex zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den UNGC-Grundsätzen und den OECD-Leitsätzen auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die nachstehend aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	189,05	75,09%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	166,84	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	73,78%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	73,78%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	100,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC	Finanzsektor	1,69%	USA
DISH DBS Corporation	Kommunikationsdienste	1,68%	USA
CSC HOLDINGS, LLC	Kommunikationsdienste	1,65%	USA
CCO HOLDINGS, LLC	Kommunikationsdienste	1,65%	USA
BARCLAYS PLC	Finanzsektor	1,20%	Vereinigtes Königreich
NCL CORPORATION LTD.	Zyklische Konsumgüter	1,18%	USA
FIRST QUANTUM MINERALS LTD.	Grundstoffe	1,13%	Kanada
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD.	Zyklische Konsumgüter	1,10%	USA
UNITED RENTALS (NORTH AMERICA), INC.	Industrie	1,08%	USA
CAESARS ENTERTAINMENT, INC.	Zyklische Konsumgüter	1,07%	USA
Carnival Corporation	Zyklische Konsumgüter	1,01%	USA
ALTICE FRANCE SA	Kommunikationsdienste	0,97%	Luxemburg
AMERICAN AIRLINES, INC.	Industrie	0,97%	USA
BATH & BODY WORKS, INC.	Zyklische Konsumgüter	0,96%	USA
ROCKET MORTGAGE, LLC	Finanzsektor	0,95%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

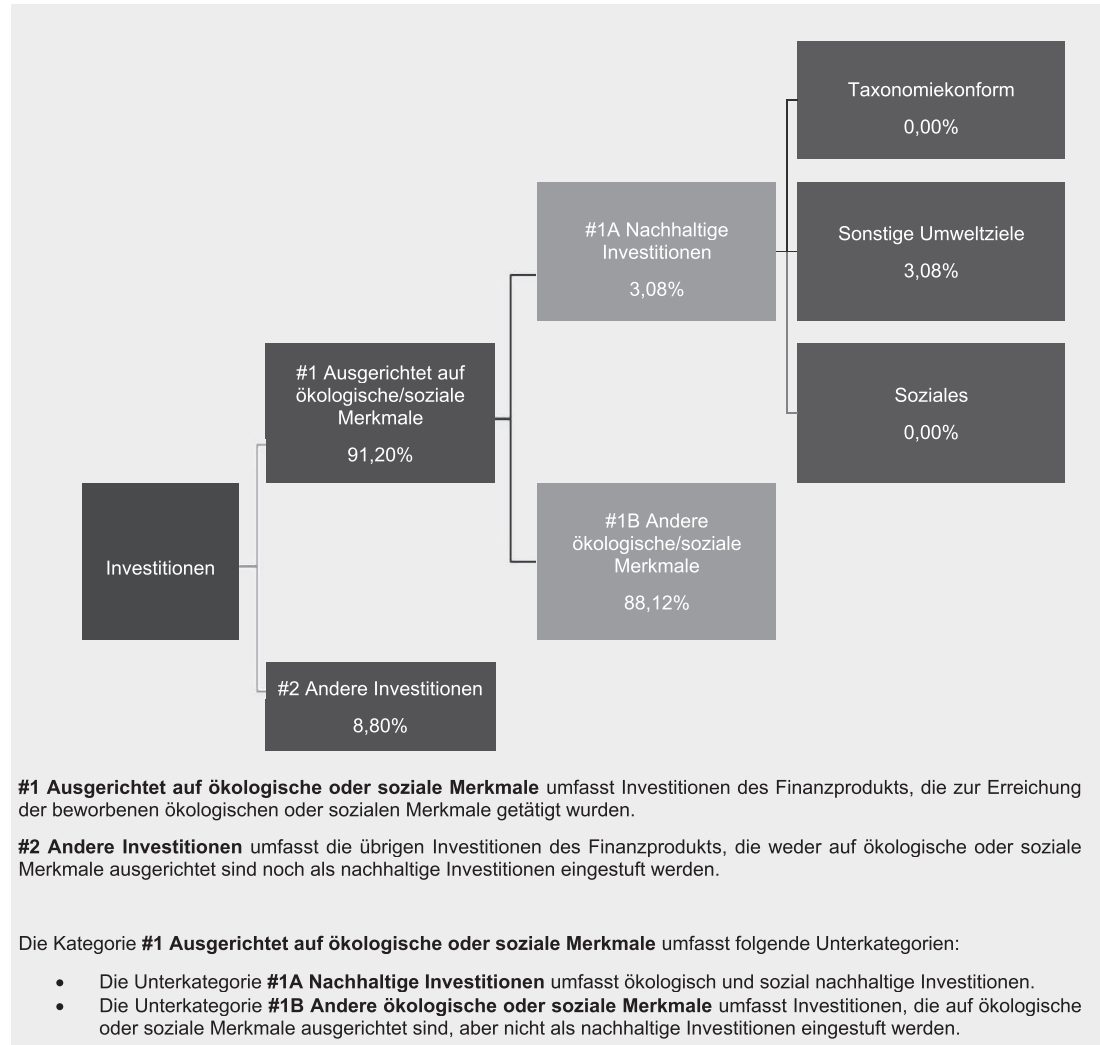
Zum 29. Februar 2024 lag der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen bei 3,08 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Zum 29. Februar 2024 waren 91,20 % des Fonds auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (8,80 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 3,08 % seines Vermögens in nachhaltige Anlagen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	26,02%
Zyklische Konsumgüter	19,46%
Industrie	13,11%
Kommunikationsdienste	12,86%
Energie	7,19%
Gesundheitssektor	6,13%
Informationstechnologie	4,25%
Grundstoffe	4,15%
Immobilien	2,50%
Versorgungsunternehmen	1,95%
Basiskonsumgüter	0,69%
Staatsanleihen	0,25%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	15,93%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	10,00%
Medien	8,56%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	6,36%
Banken	4,98%
Fachhandel	3,37%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	3,30%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,04%
Metalle u. Bergbau	2,78%
Pharmaindustrie	2,53%
Passagierfluggesellschaften	2,43%
Fahrzeugkomponenten	2,29%
Kundenkreditgeschäft	2,25%
Maschinen	2,03%
Diversifizierte Verbraucherdienstleistungen	1,99%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

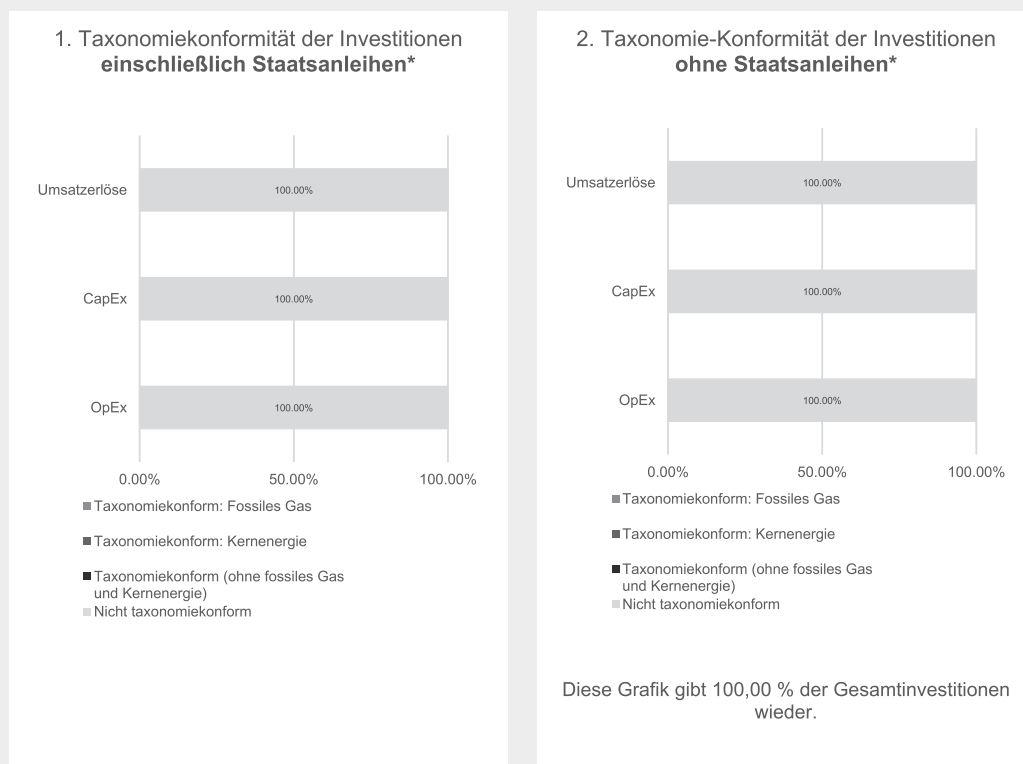
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 (17) SFDR, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds zum 29. Februar 2024 3,08 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 29. Februar 2024 betrug der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen 8,80 % und umfasste liquide Mittel und Derivate oder andere Emittenten ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (Weighted Average Carbon Intensity, „WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.

B. Der Fonds war zudem bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.

C. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:

a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.

b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.

c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).

d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

e. Bundesstaatliche und/oder staatliche Emittenten, die vom Freedom House Index nicht als „frei“ bezeichnet werden (im Einklang mit PAI-Indikator Nr. 16, Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 3,08 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

A. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 71,8 % der Benchmark.

B. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 46,4 % ggü. 43,1 % der Benchmark.

C. Der Fonds hatte zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 3,08 % in nachhaltige Anlagen investiert.

D. Die Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die erworbenen ökologischen oder

Nicht zutreffend

sozialen Merkmale
erreicht.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493004GEBFENJC57G38



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 7,74% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - o THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - o Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - o Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 29. Februar 2024 bei 7,74 %.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	213,05	63,38%	287,10	83,60%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	176,32	100,00%	221,40	95,50%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	64,11%	0,02%	82,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	64,11%	0,00%	83,00%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht, im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keine erheblichen Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozial nachhaltigen Anlageziele verursachten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten, darunter auch Screening-Tools, Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das sämtliche obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Konkret kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Grundsätze und die

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

OECD-Leitsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den UNGC-Grundsätzen und den OECD-Leitsätzen auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die nachstehend aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	213,05	63,38%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	176,32	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	64,11%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	64,11%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
United States of America	Staatsanleihen	3,49%	USA
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III B.V.	Gesundheitssektor	2,64%	Israel
FORD MOTOR COMPANY	Zyklische Konsumgüter	2,36%	USA
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD.	Zyklische Konsumgüter	2,15%	USA
Estados Unidos Mexicanos	Staatsanleihen	2,14%	Mexiko
Altice Financing SA	Kommunikationsdienste	2,01%	Luxemburg
CSC HOLDINGS, LLC	Kommunikationsdienste	1,94%	USA
Gobierno de la Republica Dominicana	Staatsanleihen	1,86%	Dominikanische Republik
GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO., LTD	Finanzsektor	1,81%	Kaimaninseln
H&E EQUIPMENT SERVICES, INC.	Industrie	1,46%	USA
DISH NETWORK CORPORATION	Kommunikationsdienste	1,45%	USA
INTESA SANPAOLO SPA	Finanzsektor	1,42%	Italien
CCO HOLDINGS, LLC	Kommunikationsdienste	1,38%	USA
MERCADOLIBRE, INC.	Zyklische Konsumgüter	1,36%	Brasilien
NCL CORPORATION LTD.	Zyklische Konsumgüter	1,33%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

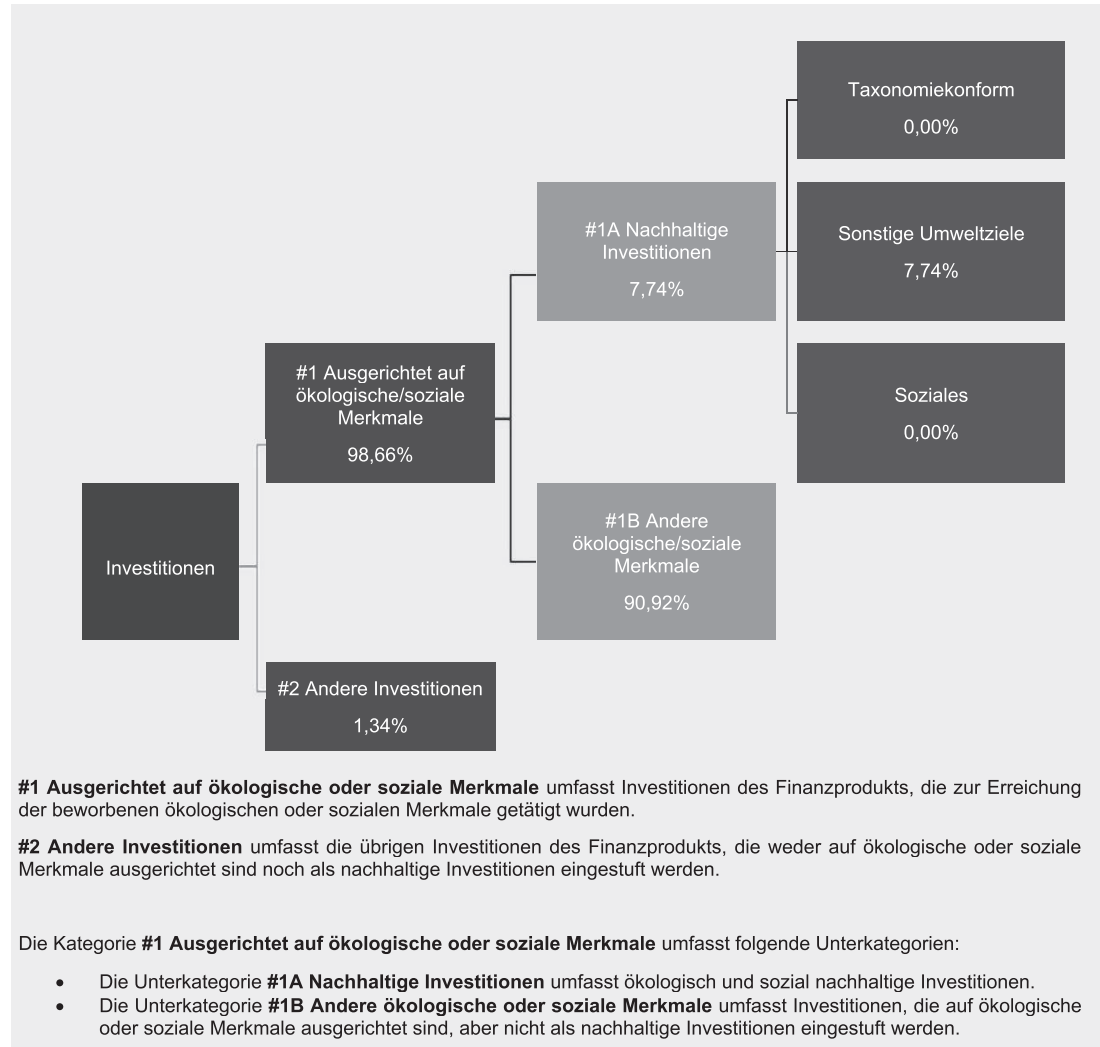
Zum 29. Februar 2024 lag der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen bei 7,74 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Zum 29. Februar 2024 waren 98,66 % des Fonds auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,34 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 7,74 % seines Vermögens in nachhaltige Anlagen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Zyklische Konsumgüter	21,49%
Staatsanleihen	19,97%
Kommunikationsdienste	16,54%
Finanzsektor	11,93%
Industrie	11,72%
Gesundheitssektor	3,63%
Grundstoffe	3,61%
Energie	2,88%
Basiskonsumgüter	2,50%
Immobilien	2,31%
Versorgungsunternehmen	1,19%
Informationstechnologie	0,82%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	19,97%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	11,87%
Medien	10,04%
Finanzdienstleistungen	5,67%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	4,72%
Banken	4,39%
Automobilindustrie	3,83%
Passagierfluggesellschaften	3,36%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	3,06%
Container und Verpackungen	2,91%
Pharmaindustrie	2,64%
Fahrzeugkomponenten	2,29%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	2,25%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	2,20%
Diversifizierte Verbraucherdienstleistungen	2,05%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

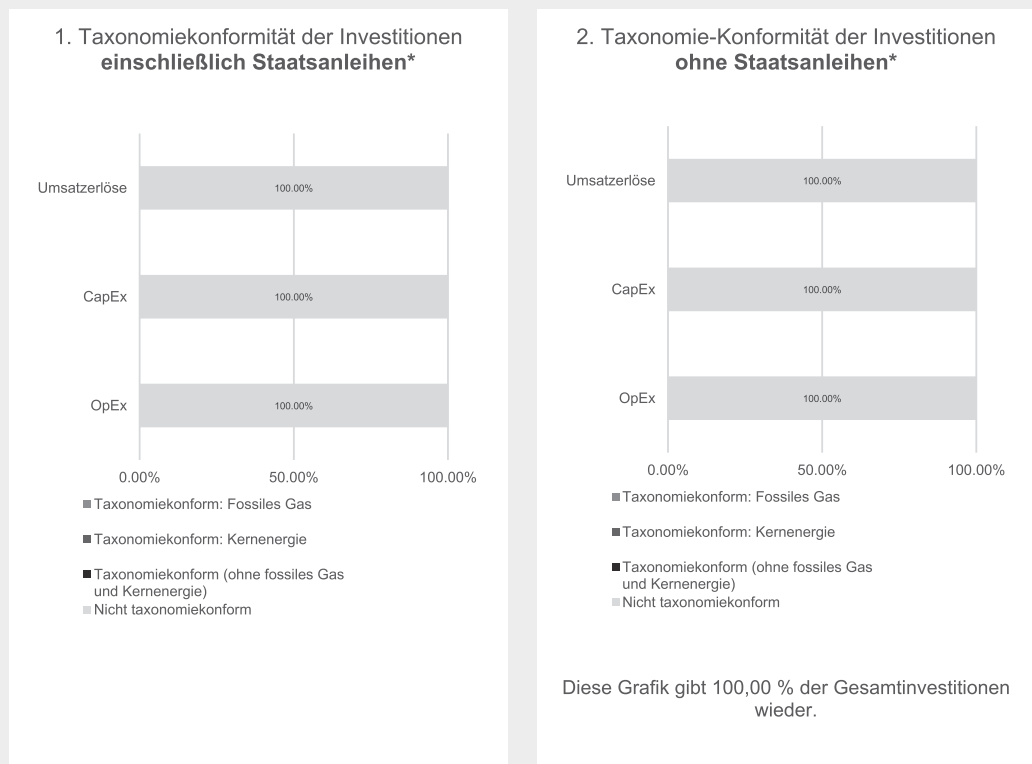
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 (17) SFDR, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds zum 29. Februar 2024 7,74 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 29. Februar 2024 betrug der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen 1,34 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (Weighted Average Carbon Intensity, „WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.

B. Der Fonds war zudem bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.

C. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:

a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.

b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.

c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).

d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 7,74 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

A. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 68,1 % der Benchmark.

B. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 44,0 % ggü. 37,5 % der Benchmark.

C. Der Fonds hatte zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 7,74 % in nachhaltige Anlagen investiert.

E. Gemäß den Definitionen von Western Asset für UNGC hatte der Fonds keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund (der „Fonds“)



FRANKLIN
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493000382HJNRHILX42

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> JA	●● <input checked="" type="checkbox"/> NEIN
<input type="checkbox"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 0,00%	<input checked="" type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben , und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 15,65% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,

- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI):

- THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
- THG-Intensität (PAI Nr. 10)
- Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14), und
- Länder, in denen investiert wird, und die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.

- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 29. Februar 2024 bei 15,65 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	64,03	90,31%	63,20	94,60%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	200,01	100,00%	247,50	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	89,84%	0,00%	95,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	90,09%	0,00%	95,00%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	100,00%	0,00	100,00%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht, im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Die Erträge solcher Anleihen wurden für Projekte eingesetzt oder hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI, einschließlich unter anderem:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keine erheblichen Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozial nachhaltigen Anlageziele verursachten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten, darunter auch Screening-Tools, Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das die wichtigsten PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die als wesentlich für den Fonds betrachtet wurden.

Konkret kamen die folgenden PAI-Indikatoren zur Anwendung: PAI Nr. 3 für die THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten; Ausschlüsse auf der Grundlage von PAI Nr. 10 für Emittenten, die die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze nicht einhalten; PAI Nr. 14 für Emittenten im gesamten Fonds (gegenüber denjenigen im investierbaren Anlageuniversum), die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen; und PAI Nr. 16 für Länder, in die investiert wird und die von Freedom House nicht als frei bezeichnet werden.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt den Referenzindex zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den UNGC-Grundsätzen und den OECD-Leitsätzen auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die nachstehend aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	64,03	90,31%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	200,01	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	89,84%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	90,09%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	100,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
United States of America	Staatsanleihen	3,01%	USA
ABN AMRO Bank N.V.	Finanzsektor	1,79%	Niederlande
BANCO SANTANDER, S.A.	Finanzsektor	1,68%	Spanien
BNP PARIBAS SA	Finanzsektor	1,62%	Frankreich
Nederlandse Waterschapsbank N.V.	Staatsanleihen	1,61%	Niederlande
BANK OF AMERICA CORPORATION	Finanzsektor	1,60%	USA
NATWEST MARKETS PLC	Finanzsektor	1,47%	Vereinigtes Königreich
DNB BANK ASA	Finanzsektor	1,43%	Norwegen
CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH	Finanzsektor	1,38%	Frankreich
JPMORGAN CHASE & CO.	Finanzsektor	1,35%	USA
HSBC HOLDINGS PLC	Finanzsektor	1,34%	Vereinigtes Königreich
SANOFI SA	Gesundheitssektor	1,31%	Frankreich
Aktiebolaget Svensk Exportkredit	Staatsanleihen	1,26%	Schweden
Siemens Financieringsmaatschappij N.V.	Industrie	1,26%	Deutschland
CITIGROUP INC.	Finanzsektor	1,24%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

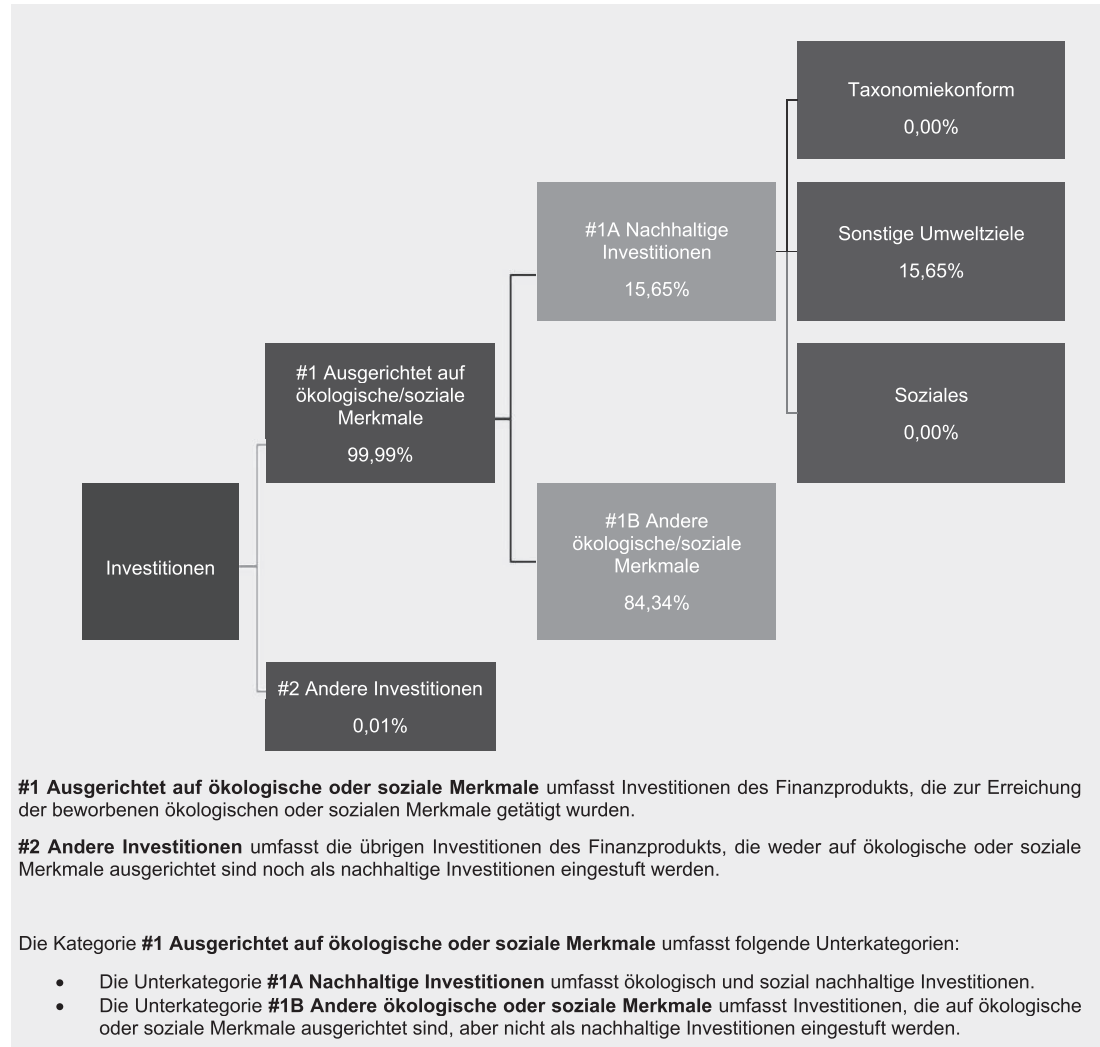
Zum 29. Februar 2024 lag der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen bei 15,65 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Zum 29. Februar 2024 waren 99,99 % des Fonds auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,01 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorrangig aus liquiden Mitteln oder Derivaten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 15,65 % seines Vermögens in nachhaltige Anlagen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	39,30%
Gesundheitssektor	11,61%
Industrie	9,85%
Staatsanleihen	9,60%
Basiskonsumgüter	7,62%
Zyklische Konsumgüter	4,57%
Immobilien	3,14%
Informationstechnologie	3,10%
Energie	2,94%
Versorgungsunternehmen	2,74%
Grundstoffe	2,24%
Kommunikationsdienste	1,81%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	22,73%
Staatsanleihen	9,60%
Pharmaindustrie	9,42%
Finanzdienstleistungen	6,32%
Kapitalmärkte	5,74%
Kundenkreditgeschäft	3,04%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	2,71%
Stromversorger	2,26%
Chemische Erzeugnisse	2,24%
Getränke	2,06%
Überlandtransport	2,02%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	1,87%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	1,65%
Produkte für den persönlichen Bedarf	1,64%
Maschinen	1,60%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

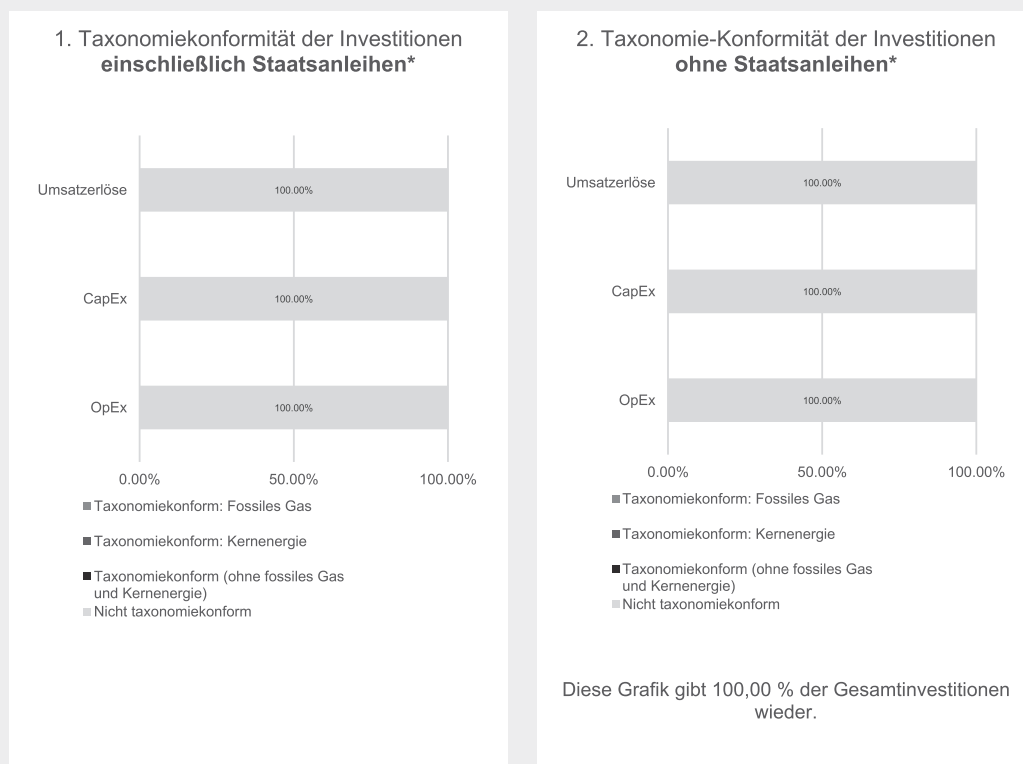
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 (17) SFDR, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds zum 29. Februar 2024 15,65 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 29. Februar 2024 betrug der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen 0,01 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine und/oder sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, sodass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.

B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.

C. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.

D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:

a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.

b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.

c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).

d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

e. Bundesstaatliche und/oder staatliche Emittenten, die vom Freedom House Index nicht als „frei“ bezeichnet werden, im Einklang mit PAI-Indikator Nr. 16 (Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 15,65 % investiert.

Der Fonds bewarb ökologische und/oder nachhaltige Merkmale anhand der oben genannten Leitlinien, wie unten hervorgehoben:

A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von AA.

B. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 45,5 % der Benchmark.

C. Die Zuordnung des Fonds zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 87,6 %.

D. Der Fonds hatte zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 15,65 % in nachhaltige Anlagen investiert.

E. Der Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.

F. Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen

Nicht zutreffend

gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
54930030VHR7UP4BBZ30



**FRANKLIN
TEMPLETON**

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 3,71% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - o THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - o Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - o Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.

Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 29. Februar 2024 bei 3,71 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	64,51	30,03%	67,50	88,80%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	197,16	100,00%	231,40	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	30,89%	0,00%	87,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	30,89%	0,00%	87,00%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Das Ziel der nachhaltigen Investitionen des Fonds war die Reduzierung der THG-Emissionen, gemessen anhand der gewichteten durchschnittlichen Kohlenstoffintensität. Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht, im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keine erheblichen Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozial nachhaltigen Anlageziele verursachten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten, darunter auch Screening-Tools, Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das sämtliche obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den UNGC-Grundsätzen und den OECD-Leitsätzen auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die nachstehend aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	64,51	30,03%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	197,16	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	30,89%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	30,89%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
United States of America	Staatsanleihen	18,53%	USA
Federal National Mortgage Association	Finanzsektor	8,27%	USA
Bundesrepublik Deutschland	Staatsanleihen	7,96%	Deutschland
FRANKLIN RESOURCES, INC.	Finanzsektor	7,50%	USA
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	Staatsanleihen	4,82%	Vereinigtes Königreich
Government National Mortgage Association	Finanzsektor	4,52%	USA
Estados Unidos Mexicanos	Staatsanleihen	3,60%	Mexiko
Freddie Mac	Finanzsektor	2,36%	USA
Republique Francaise	Staatsanleihen	2,17%	Frankreich
Japan	Staatsanleihen	1,60%	Japan
Republica Federativa do Brasil	Staatsanleihen	1,49%	Brasilien
Rzeczpospolita Polska	Staatsanleihen	1,26%	Polen
Republic of South Africa	Staatsanleihen	1,19%	Südafrika
Government of the Republic of Korea	Staatsanleihen	1,15%	Südkorea
Pemerintah Republik Indonesia	Staatsanleihen	1,05%	Indonesien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

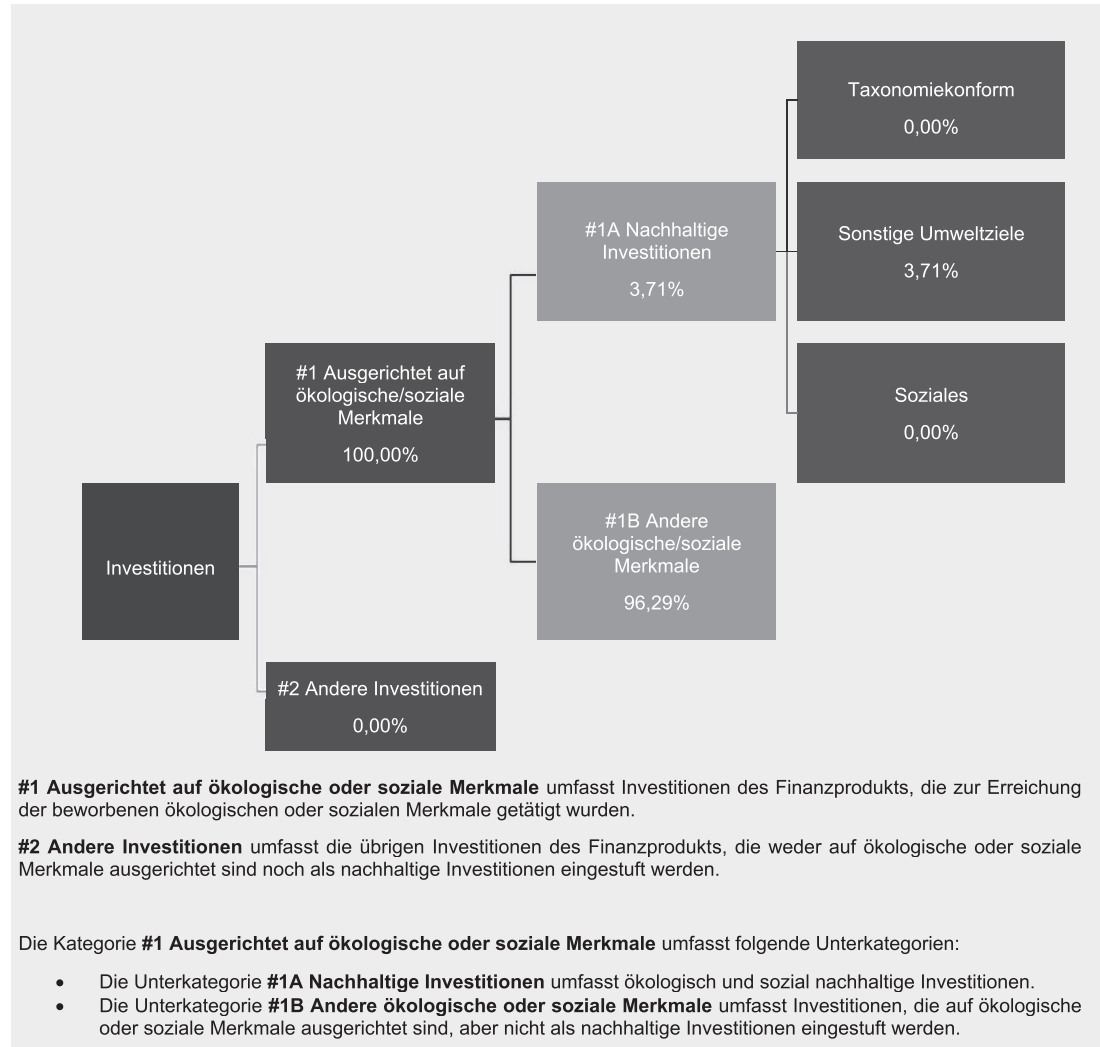
Zum 29. Februar 2024 lag der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen bei 3,71 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Zum 29. Februar 2024 waren 99,998 % des Fonds auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,002 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorrangig aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 3,71 % seines Vermögens in nachhaltige Anlagen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	54,43%
Finanzsektor	30,91%
Kommunikationsdienste	3,12%
Gesundheitssektor	2,66%
Energie	1,17%
Zyklische Konsumgüter	1,02%
Immobilien	0,81%
Grundstoffe	0,76%
Basiskonsumgüter	0,43%
Industrie	0,39%
Versorgungsunternehmen	0,17%
Informationstechnologie	0,14%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	54,43%
Finanzdienstleistungen	18,60%
Banken	8,50%
Kapitalmärkte	2,22%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,72%
Medien	1,40%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	1,17%
Versicherungen	0,99%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	0,73%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	0,68%
Unterhaltung	0,56%
Pharmaindustrie	0,49%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	0,48%
Papier u. Forstprodukte	0,47%
Biotechnologie	0,43%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

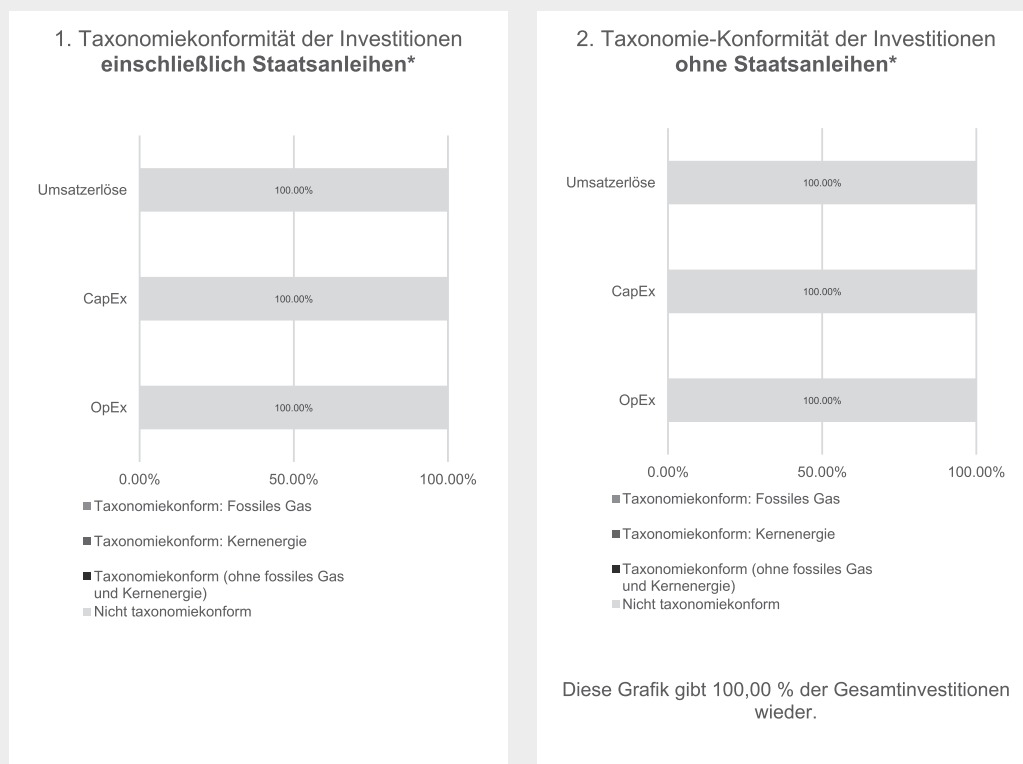
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 (17) SFDR, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds zum 29. Februar 2024 3,71% „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zum 29. Februar 2024 betrug der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ 0,002 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.
- Der Fonds war bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapieren von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.
- Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstoßen, wie unten ausgeführt:
 - Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
 - Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.
 - Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).
 - Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 3,71 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von A.
- Der WACI des Fonds lag bei 75,9 % der Benchmark.
- Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 22,1 % ggü. 17,8 % der Benchmark.
- Der Fonds hatte zum 29. Februar 2024 gemessen am prozentualen Marktwert 3,71 % in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anlagen investiert.
- Gemäß den Definitionen von Western Asset für UNGC hatte der Fonds keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das

Nicht zutreffend

Finanzprodukt die
beworbenen
ökologischen oder
sozialen Merkmale
erreicht.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300TFZOEP7EEQG432



**FRANKLIN
TEMPLETON**

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Nicht jedes unten angegebene ökologische und/oder soziale Merkmal war zu jedem Zeitpunkt in jeder Investition oder im Fonds enthalten.

In Bezug auf seine Investitionen in Staatsanleihen bewarb der Fonds die folgenden ökologischen Merkmale:

- Luftqualität
- Artenvielfalt und Schutzgebiete (Ozeane)
- Artenvielfalt und Schutzgebiete (Land)
- Anpassungsfähigkeit an den Klimawandel
- Exponiertheit gegenüber dem Klimawandel
- Sensibilität gegenüber dem Klimawandel
- Anfälligkeit gegenüber dem Klimawandel
- CO₂-Emissionen aus Energienutzung
- CO₂-Emissionen aus Veränderungen der Landnutzung und Forstwirtschaft
- CO₂-Politik – staatlich
- Abhängigkeit vom Export fossiler Brennstoffe
- Abholzung
- Dürrierisiko
- Energiesicherheit
- Umweltstress
- THG-Emissionen insgesamt
- Verringerung THG-Emissionen: Fortschritt gegenüber Zielsetzung
- Volkswirtschaft mit geringem CO₂-Ausstoß
- Ressourcensicherheit
- Abfallmanagement
- Wasserverschmutzung
- Wassersicherheit

In Bezug auf seine Investitionen in Staatsanleihen bewarb der Fonds die folgenden sozialen Merkmale:

- Zugang zu Risikoabhilfe
- Kinderarbeit
- Zivile Unruhen
- Diskriminierung am Arbeitsplatz
- Angemessene Löhne und Gehälter
- Bildung

- Versammlungsfreiheit und Tarifautonomie
- Ernährungssicherheit
- Medizinische Versorgung
- Humankapital
- Rechte indigener Völker
- Schwarzarbeit
- Ausländische Beschäftigte
- Minderheitenrechte
- Moderne Sklaverei
- Gesundheitsschutz und Sicherheit am Arbeitsplatz
- Armut
- Sexuelle Minderheiten
- Entwicklung der Bevölkerung im erwerbsfähigen Alter
- Rechte von Frauen und Mädchen
- Junge Arbeitskräfte

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen zu den schwächsten 10 % zählten (niedrigstes Dezil), wurden während des Berichtszeitraums aus dem investierbaren Anlageuniversum ausgeschlossen.

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen in die Spanne zwischen die unteren 10 % und 20 % fallen (zweitniedrigstes Dezil), wurden als Kandidaten während des Berichtszeitraums behandelt.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

A. Spezifische Eingaben in die von der Anlageverwaltung eingesetzte ESG-Scoring-Methode, die mit den vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen im Einklang standen. Diese Informationen haben folgenden Ursprung:

1. Anwendung der ESG-Ausschlüsse.

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Republik Südafrika.

B. Nachverfolgung der verpflichtenden Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren). Siehe dazu die Werte im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen:

Vorherige Periode: Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

Laufende Periode: Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen:

Vorherige Periode: Malaysia

Laufende Periode: Republik Südafrika

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO ₂ e/Mio. \$ Umsatz	386,70	83,31%	488,87	86,14%
Investitionsländer, in denen soziale	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	83,31%	0,00	86,14%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Verstöße vorkommen					

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

-----**Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Nicht zutreffend. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAIs für Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung nutzte zur Beurteilung von Verbesserungen und Verbesserungschancen auch Veränderungen in PAIs und damit zusammenhängenden KPIs, die daher als Informationsgrundlage für Anlagen und Positionsgrößen dienen. Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen Schwellenwerte für das Prinzip „keine erheblichen Beeinträchtigungen“ auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios. Die zwei PAIs für Staaten (PAI 15 (THG-Emissionsintensität) und PAI 16 (Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen) waren Bestandteil der eigenen ESG-Scoring-Methode der Anlageverwaltung.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	386,70	83,31%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	83,31%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
United States of America	Staatsanleihen	36,23%	USA
Estados Unidos Mexicanos	Staatsanleihen	11,13%	Mexiko
International Bank for Reconstruction and Development	Staatsanleihen	9,90%	Supranationale
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	Staatsanleihen	6,19%	Vereinigtes Königreich
Republica Federativa do Brasil	Staatsanleihen	5,18%	Brasilien
Republica de Colombia	Staatsanleihen	5,07%	Kolumbien
Bundesrepublik Deutschland	Staatsanleihen	4,19%	Deutschland
Statsministerens Kontor	Staatsanleihen	3,93%	Norwegen
Republic of South Africa	Staatsanleihen	3,45%	Südafrika
KfW	Staatsanleihen	3,20%	Deutschland
Commonwealth of Australia	Staatsanleihen	3,09%	Australien
Gobierno de Chile	Staatsanleihen	2,60%	Chile
Province of Manitoba	Staatsanleihen	1,46%	Kanada
New Zealand	Staatsanleihen	1,32%	Neuseeland
France	Staatsanleihen	1,00%	Frankreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

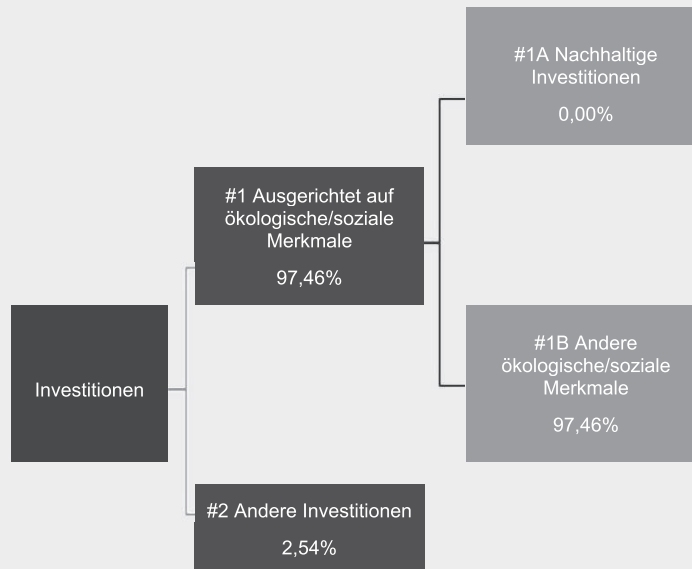
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 0 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,46 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,54 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Der Fonds hat keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	98,83%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatlich	84,27%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

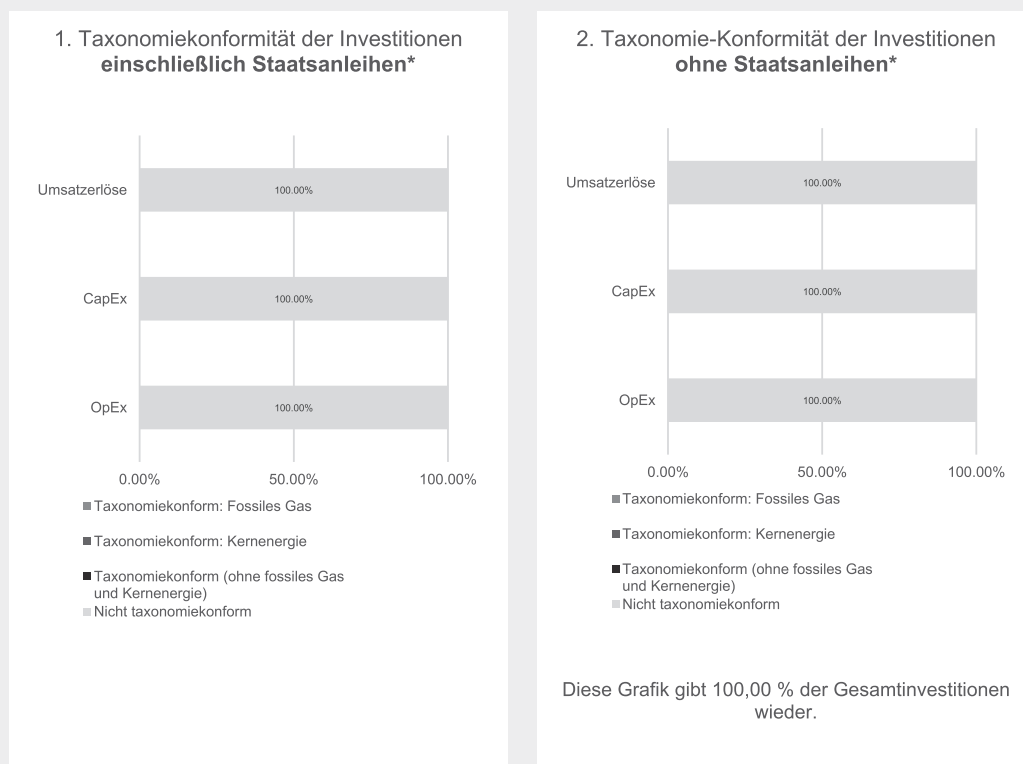
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

An nicht mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen mit einem Umweltziel wies das Finanzprodukt folgenden Anteil auf: 0,00%.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

An Investitionen mit einem sozialen Ziel wies das Finanzprodukt folgenden Anteil auf: 0,00%.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Das Finanzprodukt wies einen Anteil von 2,54%% an Investitionen auf, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.
2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Republik Südafrika
3. Bis zu 90 % der Investitionen wurden in Hinblick auf die Verschlechterung oder Verbesserung von den Umweltschutz und soziale Aspekte betreffenden Faktoren nachverfolgt und überwacht.
4. Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493003731Z316KVU890



**FRANKLIN
TEMPLETON**

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> JA	●● <input checked="" type="checkbox"/> NEIN
<input type="checkbox"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 0,00%	<input checked="" type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben , und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 5,52% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben , aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die Fondsstrategie orientierte sich nicht an einem Referenzindex. Daher spiegelten die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale mehrere Rentensektoren wider und wurden nach Ländern, Fundamentaldaten und Sektoren angegeben. Nicht jedes unten angegebene ökologische und/oder soziale Merkmal war zu jedem Zeitpunkt in jeder Investition oder im Fonds enthalten.

Die ökologischen Merkmale von Staaten, die der Fonds für seine Anlagen in Staatsanleihen bewirbt, waren:

- Luftqualität
- Artenvielfalt und Schutzgebiete (Ozeane)
- Artenvielfalt und Schutzgebiete (Land)
- Anpassungsfähigkeit an den Klimawandel
- Exponiertheit gegenüber dem Klimawandel
- Sensibilität gegenüber dem Klimawandel
- Anfälligkeit gegenüber dem Klimawandel
- CO2-Emissionen aus Energienutzung
- CO2-Emissionen aus Veränderungen der Landnutzung und Forstwirtschaft
- CO2-Politik – staatlich
- Abhängigkeit vom Export fossiler Brennstoffe
- Abholzung
- Dürrerisiko
- Energiesicherheit
- Umweltstress
- THG-Emissionen insgesamt
- Verringerung THG-Emissionen: Fortschritt gegenüber Zielsetzung
- Volkswirtschaft mit geringem CO2-Ausstoß
- Ressourcensicherheit
- Abfallmanagement
- Wasserverschmutzung
- Wassersicherheit

In Bezug auf seine Investitionen in Staatsanleihen bewarb der Fonds die Folgenden sozialen Merkmale:

- Zugang zu Risikoabhilfe
- Kinderarbeit
- Zivile Unruhen
- Diskriminierung am Arbeitsplatz

- Angemessene Löhne und Gehälter
- Bildung
- Versammlungsfreiheit und Tarifautonomie
- Ernährungssicherheit
- Medizinische Versorgung
- Humankapital
- Rechte indigener Völker
- Schwarzarbeit
- Ausländische Beschäftigte
- Minderheitenrechte
- Moderne Sklaverei
- Gesundheitsschutz und Sicherheit am Arbeitsplatz
- Armut
- Sexuelle Minderheiten
- Entwicklung der Bevölkerung im erwerbsfähigen Alter
- Rechte von Frauen und Mädchen
- Junge Arbeitskräfte

Die unternehmerischen, ökologischen und sozialen Merkmale, die der Fonds bei seinen Anlagen in Unternehmensanleihen bewirbt, waren:

- THG-Emissionen
- CO₂-Fußabdruck
- THG-Intensität der Firmen, in die investiert wird
- Exponiertheit gegenüber Unternehmen mit Aktivitäten in fossilen Brennstoffen
- Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.
- Intensität des Energieverbrauchs je Sektor mit starken Auswirkungen auf das Klima
- Aktivitäten, die die Artenvielfalt in sensiblen Bereichen schädigen
- Emissionen in Wasser
- Anteil gefährlicher Abfälle
- Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne
- Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne
- Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle
- Geschlechtservielfalt im Vorstand
- Exponiertheit gegenüber umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Kampfstoffe)

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen zu den schwächsten 10 % zählten (niedrigstes Dezil), wurden während des Berichtszeitraums aus dem investierbaren Anlageuniversum ausgeschlossen.

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen in die Spanne zwischen die unteren 10 % und 20 % fallen (zweitniedrigstes Dezil), wurden als Kandidaten während des Berichtszeitraums behandelt.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

A. Spezifische Eingaben in die von der Anlageverwaltung eingesetzte ESG-Scoring-Methode, die mit den vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen im Einklang standen. Diese Informationen haben folgenden Ursprung:

1. Anwendung der ESG-Ausschlüsse.

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen: World Acceptance Corp.

2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., Mexiko, Devon Energy Corporation, Kolumbien, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, Republik Südafrika, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasilien, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

B. Nachverfolgung der verpflichtenden Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren), die für den jeweiligen Emittenten relevant sind. Siehe dazu die Werte im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“

C. Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen (GSS) Anleihen mit 5,52 %. Die Verwendung der Erträge dieser Anleihen wurden von Emittenten angegeben (und durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft), und kamen den zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugute, wie zum Beispiel:

- Saubere Mobilität u. Verminderung von Umweltverschmutzung
- Recyceltes Wasser
- Bezahlbare und saubere Energie
- Bekämpfung von Armut u. Ungleichheit
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen:

Vorherige Periode: Hercules Capital, Weibo Corp, Meta Platforms

Laufende Periode: World Acceptance Corp.

Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen:

Vorherige Periode: Carnival Cruise Corp., Dish Network Corp., Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation und Brasilien.

Laufende Periode: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., Mexiko, Devon Energy Corporation, Kolumbien, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, Republik Südafrika, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasilien, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen (GSS) Anleihen

Vorherige Periode: 1,18 %. Die Verwendung der Erträge dieser Anleihen wurden von Emittenten angegeben (und durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft), und kamen den zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugute, wie zum Beispiel:

- Verringerung THG-Emissionen:
- Gestiegene Produktverfügbarkeit in Ländern mit niedrigen und mittleren Einkommen
- Schaffen von nachhaltigen Städten und eines sozialen Umfelds, in denen Transportwesen, Energie sowie Wasserversorgung und Hygiene nach ökologischen Aspekten gestaltet und finanziert werden können
- Initiativen zum Erreichen von Diversität, Chancengleichheit und Inklusion

Laufende Periode: 5,52 %. Die Verwendung der Erträge dieser Anleihen wurden von Emittenten angegeben (und durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft), und kamen den zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugute, wie zum Beispiel:

- Saubere Mobilität u. Verminderung von Umweltverschmutzung
- Recyceltes Wasser
- Bezahlbare und saubere Energie
- Bekämpfung von Armut u. Ungleichheit
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Reichweite 1 USD	tCO2e	53 490,50	55,78%	N/A	N/A
THG-Emissionen: Reichweite 2 USD	tCO2e	7 045,43	55,78%	N/A	N/A
THG-Emissionen: Reichweite 3 USD	tCO2e	291 970,00	55,68%	N/A	N/A
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	352 506,00	55,78%	N/A	N/A
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	547,83	55,78%	353,95	60,85%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 130,77	68,20%	N/A	N/A
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	7,53%	58,36%	4,57%	56,49%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	79,28%	28,23%	74,19%	26,47%
Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,00	24,63%	0,00	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	1,72	24,63%	2,21	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs : Fertigung (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	1,56	24,63%	0,50	22,03%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs : Strom (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	6,24	24,63%	6,02	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs : Wasser (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,73	24,63%	0,66	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs : Bauwesen (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	15,78	24,63%	0,00	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,03	24,63%	0,04	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,99	24,63%	3,12	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,00	24,63%	0,00	22,03%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	58,36%	0,00%	56,49%
Emissionen in Wasser (USD)	Metrische Tonnen (USD)	0,00	0,10%	210,48	1,86%
Gefährliche Abfälle (USD)	Metrische Tonnen (USD)	1,27	9,28%	433,96	9,94%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	59,78%	0,00%	59,25%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	48,12%	58,36%	44,00%	54,74%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	20,02%	8,43%	18,47%	5,64%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	28,21%	50,44%	29,84%	56,02%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	58,36%	0,00%	56,49%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	437,25	24,40%	481,49	10,54%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	24,40%	0,00	10,54%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds investierte mindestens 1 % seines Nettovermögens in grüne und/oder soziale Anleihen, die nachhaltige Geldanlagen sind. Der Fonds investierte nur in Anleihen, bei denen der Emittent angab, wofür die Erträge verwendet werden (und bei denen diese Angaben durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft werden), und die zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugutekamen, wie zum Beispiel:

- Verringerung THG-Emissionen:
- Gestiegene Produktverfügbarkeit in Ländern mit niedrigen und mittleren Einkommen
- Schaffen von nachhaltigen Städten und eines sozialen Umfelds, in denen Transportwesen, Energie sowie Wasserversorgung und Hygiene nach ökologischen Aspekten gestaltet und finanziert werden können
- Initiativen zum Erreichen von Diversität, Chancengleichheit und Inklusion

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Bei der Bewertung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH-Grundsatz“) stützte sich die Anlageverwaltung auf internes Fundamentaldaten-Research, verkaufsseitiges Research, Angaben zu wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) und ESG-Daten von externen Anbietern.

Die Anlageverwaltung prüfte sämtliche bei Screening-Prüfungen von einem Drittanbieter angezeigten öffentlichen Sanktionen im Zusammenhang mit der Nichteinhaltung des UN Global Compact (UNGC) sowie Messdaten und KPIs im Zusammenhang mit den obligatorischen PAI-Prüfungen für Unternehmen und staatliche Emittenten. Für nachhaltige Geldanlagen in von Unternehmen ausgegebene Wertpapiere prüfte die Anlageverwaltung den DNSH-Grundsatz auf der Ebene des emittierenden Unternehmens. Für nachhaltige Geldanlagen in von staatlichen Stellen oder supranationalen Organisationen emittierte Wertpapiere prüfte die Anlageverwaltung den DNSH-Grundsatz auf Ebene der Ertragsverwendung (außer bei supranationalen Organisationen, deren spezifisches Leitbild vorsieht, dass alle finanzierten Aktivitäten/Projekte nachhaltig sein müssen).

Der Fonds überwachte die obligatorischen PAI-Werte, um Anlagen mit nachteiligen Auswirkungen zu ermitteln.

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen DNSH-Schwellenwerte auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios. Dabei setzt die Anlageverwaltung zunächst auf aktive Zusammenarbeit mit den Emittenten und zieht sich erst als letzte Maßnahme aus einer Anlage zurück. Wurde ein wesentliches kurzfristiges Risiko entdeckt, veräußerte die Anlageverwaltung eine Anlage sofort.

-----**Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Die Anlageverwaltung verfolgte Verstöße gegen OECD/UNGC-Grundsätze (die ab Januar 2022 automatisch von Dritten eingeholt werden) und Versäumnisse; Unternehmen, die sich nicht daran hielten, werden vom Portfolio/Anlageuniversum ausgeschlossen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung nutzte zur Beurteilung von Verbesserungen und Verbesserungschancen auch Veränderungen in PAIs und damit zusammenhängenden KPIs, die daher als Informationsgrundlage für Anlagen und Positionsgrößen dienten.

Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen DNSH-Schwellenwerte auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios.

Nicht alle obligatorischen PAIs waren inhärente Bestandteile der eigenen ESG-Bewertung für diesen Fonds. Die Anlageverwaltung verfolgte dennoch die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) nach und beobachtete diese.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Reichweite 1 USD	tCO2e	53 490,50	55,78%
THG-Emissionen: Reichweite 2 USD	tCO2e	7 045,43	55,78%
THG-Emissionen: Reichweite 3 USD	tCO2e	291 970,00	55,68%
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	352 506,00	55,78%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	547,83	55,78%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 130,77	68,20%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	7,53%	58,36%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	79,28%	28,23%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,00	24,63%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	1,72	24,63%
Intensität des Energieverbrauchs: Fertigung (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	1,56	24,63%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	6,24	24,63%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,73	24,63%
Intensität des Energieverbrauchs: Bauwesen (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	15,78	24,63%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,03	24,63%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,99	24,63%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,00	24,63%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	58,36%
Emissionen in Wasser (USD)	Metrische Tonnen (USD)	0,00	0,10%
Gefährliche Abfälle (USD)	Metrische Tonnen (USD)	1,27	9,28%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	59,78%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	48,12%	58,36%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	20,02%	8,43%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	28,21%	50,44%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	58,36%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	437,25	24,40%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	24,40%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
COLOMBIA TES 7% 03/26/31	Staatsanleihen	4,72%	Kolumbien
US TREASURY FRN FLT 01/31/25	Staatsanleihen	3,00%	USA
UK TSY GILT 3.75% 10/22/53	Staatsanleihen	2,95%	Vereinigtes Königreich
KFW 0.375% 07/18/25	Staatsanleihen	2,48%	Deutschland
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/33	Staatsanleihen	2,24%	Brasilien
MEXICAN BONOS 8% 07/31/53	Staatsanleihen	2,19%	Mexiko
INT BK RECON&DEV 4.625% 08/01/28	Staatsanleihen	1,71%	Supranationale
NEW FORTRESS 6.75% 09/15/25 144A	Energie	1,57%	USA
INT BK RECON&DEV 0.5% 10/28/25	Staatsanleihen	1,53%	Supranationale
G2SF MA8646 4.5% 02/20/53	Hypothekensanleihen	1,47%	USA
G2SF MA8801 5.5% 04/20/53	Hypothekensanleihen	1,32%	USA
DISH NETWORK 3.375% 08/15/26	Kommunikationsdienste	1,26%	USA
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/27	Staatsanleihen	1,23%	Brasilien
FIRST QUANTUM 6.875% 10/15/27 144A	Grundstoffe	1,11%	Kanada
XP INC 3.25% 07/01/26 144A	Finanzsektor	1,09%	Brasilien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

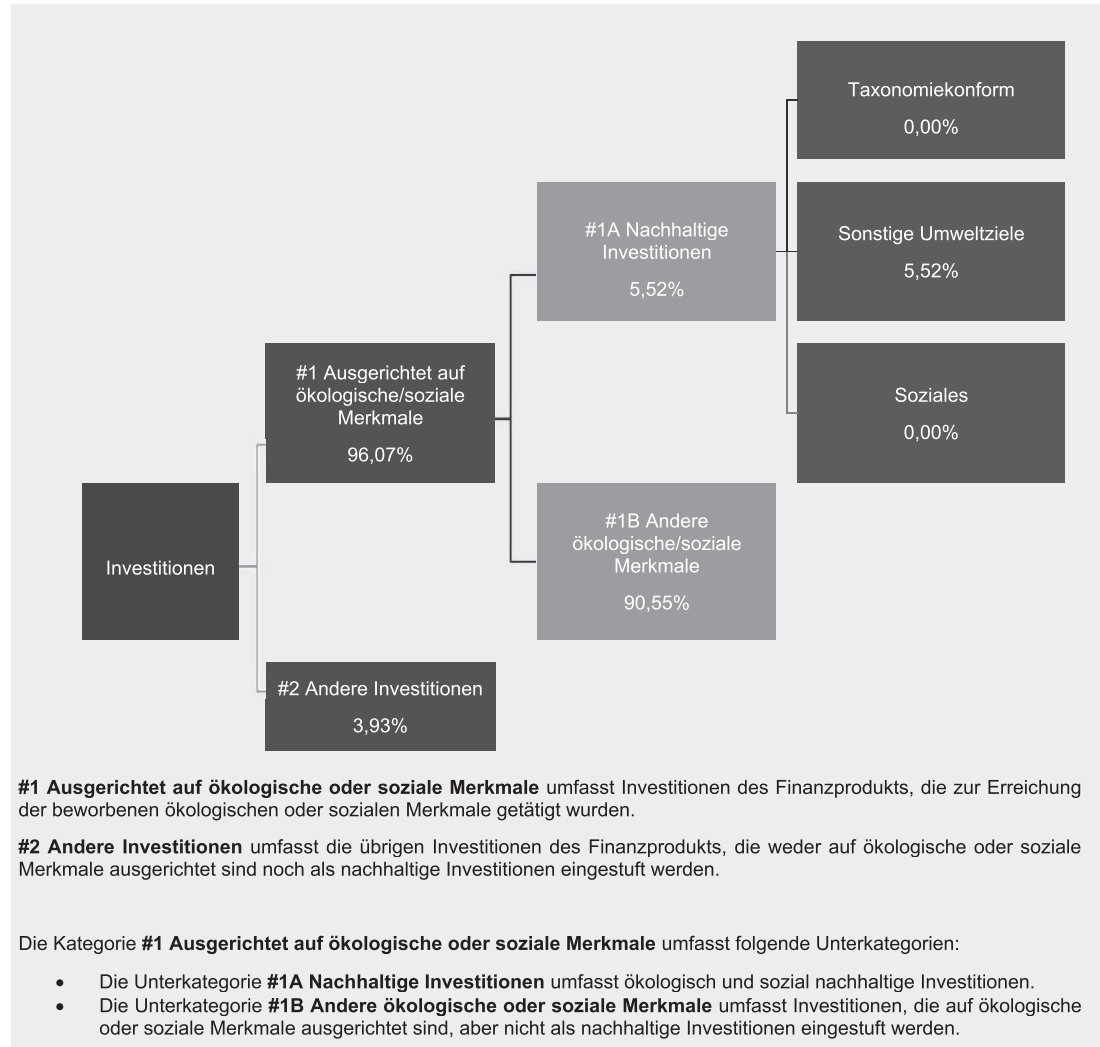
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 5,52 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

96,07 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (3,93 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Für das Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 5,52 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatlich	24,45%
Finanzen	21,73%
Hypothekenspanpapiere	12,30%
Energie	9,43%
Zyklische Konsumgüter	8,10%
Kommunikation	6,53%
Industrie	5,80%
Grundstoffe	4,18%
Nichtzyklische Konsumgüter	1,94%
Technologie	1,19%
Versorgungsunternehmen	0,29%
Forderungsbekicherte Wertpapiere	0,12%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatlich	20,66%
Investmentunternehmen	7,43%
WL Collat CMO Mezzanine	6,00%
Oil Comp-Explor&Prodtn	5,46%
Spezialbanken	4,09%
Supranationale Bank	3,79%
GNMA2 Single Family 30Yr	3,48%
Metall-Kupfer	3,30%
Pipelines	3,08%
Fluggesellschaften	2,55%
WL Collat CMO Subordinat	2,30%
Container-Papier/Kunststoff	1,94%
Automobil-Pkw/kleine Lkw	1,68%
Mobiltelekommunikation	1,64%
Diversifizierte Kreditinstitute	1,51%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

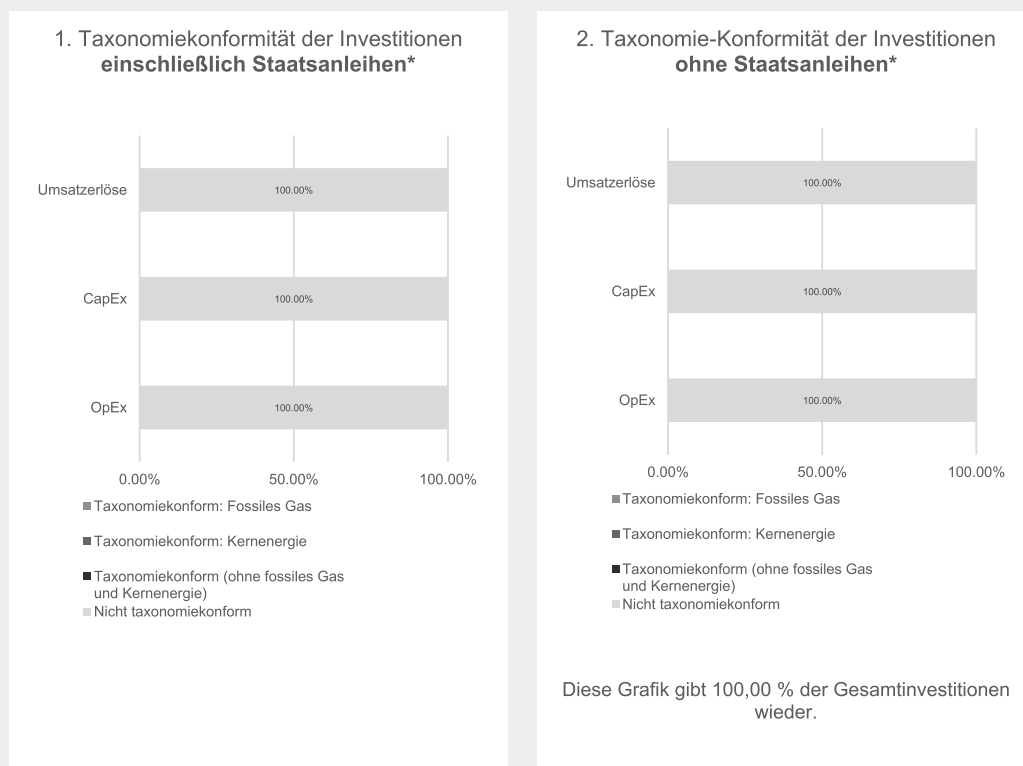
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

An nicht mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen mit einem Umweltziel wies das Finanzprodukt folgenden Anteil auf: 5,52%.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

An Investitionen mit einem sozialen Ziel wies das Finanzprodukt folgenden Anteil auf: 0,00%.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Das Finanzprodukt wies einen Anteil von 3,93% an Investitionen auf, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen: World Acceptance Corp.
2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., Mexiko, Devon Energy Corporation, Kolumbien, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, Republik Südafrika, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasilien, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.
3. Bis zu 80 % der Investitionen wurden in Hinblick auf die Verschlechterung oder Verbesserung von den Umweltschutz und/oder soziale Aspekte betreffenden Faktoren nachverfolgt und überwacht.
4. Der Fonds investierte mehr als 1 % seines Nettovermögens in nachhaltige Anlagen mit ökologischen/sozialen Zielen, siehe oben.
5. Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund (der „Fonds“)



Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900QDA77XG4LVMI92

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 18,88% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds hat eine Reihe ökologischer und sozialer Merkmale beworben. Dazu zählen unter anderem:

Umwelt:

- Begrenzung der Auswirkungen des Klimawandels;
- Anpassung an den Klimawandel;
- Wasser und
- Artenvielfalt.

Soziales:

- Chancengleichheit.

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen zu den schwächsten 10 % zählten (niedrigstes Dezil), wurden während des Berichtszeitraums aus dem investierbaren Anlageuniversum ausgeschlossen.

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen in die Spanne zwischen die unteren 10 % und 20 % fallen (zweitniedrigstes Dezil), wurden als Kandidaten während des Berichtszeitraums behandelt.

Es wurde anhand von Leistungskennzahlen (Key Performance Indicators – KPIs) beurteilt, ob ein Emittent Potenzial hat oder Fortschritte in einem aktuellen Nachhaltigkeitsbereich nachweist.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarbt, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

A. Spezifische Eingaben in die von der Anlageverwaltung eingesetzte ESG-Scoring-Methode, die mit den vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen im Einklang standen. Diese Informationen haben folgenden Ursprung:

1. Anwendung der ESG-Ausschlüsse.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen: JBS Foods, Concrete Pumping Holdings, Inc.

2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., Mexiko, Devon Energy Corporation, Kolumbien, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, Republik Südafrika, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasilien, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

B. Nachverfolgung von Leistungskennzahlen (Key Performance Indicators – KPIs), die für den jeweiligen Emittenten relevant sind. Siehe dazu die Werte im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“

C. Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen (GSS) Anleihen mit 18,88 %. Die Verwendung der Erträge dieser Anleihen wurden von Emittenten angegeben (und durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft), und kamen den zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugute, wie zum Beispiel:

- Saubere Mobilität u. Verminderung von Umweltverschmutzung
- Recyceltes Wasser
- Bezahlbare und saubere Energie
- Bekämpfung von Armut u. Ungleichheit
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
CO2-Reichweite 1 -> Niedriger	1,18%
Stromverbrauch -> Niedriger	1,21%
Gesamtemissionen -> Niedriger	0,40%
Energie pro gefertigter Einheit -> Niedriger	1,32%
Bereinigung geschlechtsspezifisches Lohngefälle / Implementierung (J/N)	1,83%
THG-Intensität bzgl. Umsatz -> Niedriger	9,23%
THG-Reichweite 1 -> Niedriger	1,28%
Menschenrechtsrichtlinie / Implementierung (J/N)	0,77%
Geschlechtsspezifisches Lohngefälle in Prozent, Mitarbeiter einschl. Management -> Niedriger	1,24%
Berücksichtigung von Minderheiten in Prozent -> Höher	0,96%
Nutzung von erneuerbarer Energie -> Höher	1,90%
Verwaltete nachhaltige ESG-Ressourcen -> Höher	1,25%
Wasserverbrauch gesamt -> Niedriger	0,96%
Durch Vertragsstaaten national festgelegter Beitrag (NDC) ggü. NGFS-Szenario für 2030	47,49%

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen:

Vorherige Periode: Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

Laufende Periode: JBS Foods, Concrete Pumping Holdings, Inc.

Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen:

Vorherige Periode: Malaysia

Laufende Periode: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., Mexiko, Devon Energy Corporation, Kolumbien, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, Republik Südafrika, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasilien, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

Es wurde anhand von Leistungskennzahlen (Key Performance Indicators – KPIs) beurteilt, ob ein Emittent Potenzial hat oder Fortschritte in einem aktuellen Nachhaltigkeitsbereich nachweist.

Vorherige Periode: k. A.

Laufende Periode: Wir werden die KPIs bei jedem Emittenten auch weiterhin verfolgen und im Auge behalten. Eine Verbesserung der KPIs wird über einen Zeitraum von zwei Jahren angestrebt. Dieser Fonds wurde im Dezember 2022 aufgelegt.

Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen (GSS) Anleihen

Vorherige Periode: k. A.

Laufende Periode: 18,88 %. Die Verwendung der Erträge dieser Anleihen wurden von Emittenten angegeben (und durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft), und kamen den zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugute, wie zum Beispiel:

- Saubere Mobilität u. Verminderung von Umweltverschmutzung
- Recyceltes Wasser
- Bezahlbare und saubere Energie

- Bekämpfung von Armut u. Ungleichheit
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert
CO2-Reichweite 1 -> Niedriger	1,18%	1,21%
Stromverbrauch -> Niedriger	1,21%	1,22%
Gesamtemissionen -> Niedriger	0,40%	N/A
Energie pro gefertigter Einheit -> Niedriger	1,32%	2,38%
Bereinigung geschlechtsspezifisches Lohngefälle / Implementierung (J/N)	1,83%	2,33%
THG-Intensität bzgl. Umsatz -> Niedriger	9,23%	11,16%
THG-Reichweite 1 -> Niedriger	1,28%	9,44%
Menschenrechtsrichtlinie / Implementierung (J/N)	0,77%	0,76%
Geschlechtsspezifisches Lohngefälle in Prozent, Mitarbeiter einschl. Management -> Niedriger	1,24%	1,24%
Berücksichtigung von Minderheiten in Prozent -> Höher	0,96%	0,97%
Nutzung von erneuerbarer Energie -> Höher	1,90%	4,15%
Verwaltete nachhaltige ESG-Ressourcen -> Höher	1,25%	2,57%
Wasserverbrauch gesamt -> Niedriger	0,96%	0,97%
Durch Vertragsstaaten national festgelegter Beitrag (NDC) ggü. NGFS-Szenario für 2030	47,49%	N/A

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Reichweite 1 USD	tCO2e	614,21	52,01%	736,47	66,42%
THG-Emissionen: Reichweite 2 USD	tCO2e	96,93	52,01%	141,25	66,42%
THG-Emissionen: Reichweite 3 USD	tCO2e	4 528,73	52,01%	4 911,81	66,42%
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	5 239,87	52,01%	5 789,53	66,42%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	659,07	52,01%	600,19	66,42%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 264,74	59,27%	1 311,56	72,02%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	6,17%	53,69%	6,82%	68,33%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	77,91%	28,22%	69,14%	36,63%
Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	150,63	26,89%	0,00	35,55%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	2,28	26,89%	2,22	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs : Fertigung (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,39	26,89%	0,27	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs : Strom (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	6,24	26,89%	6,02	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs : Wasser (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,00	26,89%	0,00	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs : Bauwesen (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	32,12	26,89%	0,00	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,06	26,89%	0,08	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,97	26,89%	1,68	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,00	26,89%	0,00	35,55%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	53,69%	0,00%	68,33%
Emissionen in Wasser (USD)	Metrische Tonnen (USD)	1 675,15	0,25%	0,23	1,03%
Gefährliche Abfälle (USD)	Metrische Tonnen (USD)	0,73	11,82%	0,79	16,57%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	54,56%	0,00%	70,21%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	42,84%	53,69%	47,75%	67,29%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	24,79%	10,60%	24,63%	8,16%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher	33,17%	50,64%	33,83%	65,83%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
	Vorstandsmitglied er				
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	53,69%	0,00%	68,33%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	385,27	35,82%	369,41	12,58%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	35,82%	0,00	12,58%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds investierte mindestens 15 % seines Nettovermögens in grüne/soziale/nachhaltige/nachhaltigkeitsbezogene Anleihen sowie in bestimmte Emittenten, die vom Anlageverwalter als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden. Der Fonds investierte nur in Anleihen, bei denen der Emittent angab, wofür die Erträge verwendet werden (und bei denen diese Angaben durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft werden), und die zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugutekamen, wie zum Beispiel:

- Umwelt:
 - Klimaschutz
 - Anpassung an den Klimawandel
 - Gewässerschutz
 - Bewahrung/Nutzung/Recycling
 - Beobachtung und Schutz der Artenvielfalt

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Bei der Bewertung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH-Grundsatz“) stützte sich die Anlageverwaltung auf internes Fundamentaldaten-Research, verkaufsseitiges Research, Nachrichten, Angaben zu wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) und ESG-Daten von externen Anbietern. Für nachhaltige Geldanlagen in von Unternehmen ausgegebene Wertpapiere prüfte die Anlageverwaltung den DNSH-Grundsatz auf der Ebene des emittierenden Unternehmens. Für nachhaltige Geldanlagen in von staatlichen Stellen oder supranationalen Organisationen emittierte Wertpapiere prüfte die Anlageverwaltung den DNSH-Grundsatz auf Ebene der Ertragsverwendung (außer bei supranationalen Organisationen, deren spezifisches Leitbild vorsieht, dass alle finanzierten Aktivitäten/Projekte nachhaltig sein müssen).

Die Anlageverwaltung prüfte sämtliche bei Screening-Prüfungen von Drittanbietern angezeigten öffentlichen Sanktionen im Zusammenhang mit der Nichteinhaltung des UN Global Compact (UNGC) sowie Messdaten und KPIs im Zusammenhang mit den obligatorischen PAI-Prüfungen für Unternehmen und staatliche Emittenten.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung nutzte zudem Veränderungen in PAIs und damit zusammenhängenden KPIs, um Chancen für Verbesserungen und Impact zu bewerten. Daher dienten sie als Informationsgrundlage für Anlagen und Positionsgrößen.

Bei der Identifikation nachhaltiger Investitionen oder der Feststellung, wo Verbesserungen im Nachhaltigkeitsprofil erforderlich waren, wurden obligatorische PAIs berücksichtigt. Außer bei PAI 10 (Verstöße gegen UNGC-Prinzipien und OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen) und PAI 14 (Engagement in umstrittenen Waffen), wurden PAI-Indikatoren als KPIs zur Nachverfolgung und Beobachtung des Fortschritts der Emittenten verwendet, in die investiert wird (wie weiter unten in dieser Anlage beschrieben). Verschlechtern sich die PAI-Indikatoren oder fehlen sie ganz, ist ein aktives Engagement zwingend vorgeschrieben, ebenso bei Bedarf eine Veräußerung des Titels und/oder ein Ausschluss aus dem Anlageuniversum.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Unternehmen mit PAI 10 oder die in PAI 14 involviert waren und Länder, die gegen soziale Bestimmungen verstießen (PAI 16), wurden vom Anlageuniversum ausgeschlossen.

Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen DNSH-Schwellenwerte auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios. Optionale PAIs und Daten in Bezug auf die EU-Taxonomie waren im Zuge ihrer Verfügbarkeit mit ausreichender Abdeckung Bestandteil der DNSH-Bewertung.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung verfolgte Verstöße gegen OECD/UNGC-Grundsätze (die automatisch von Dritten eingeholt werden) und Versäumnisse; Unternehmen, die sich nicht daran hielten, werden vom Portfolio/Anlageuniversum ausgeschlossen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.
Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet.

Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen DNSH-Schwellenwerte auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios.

Nicht alle obligatorischen PAIs waren inhärente Bestandteile der eigenen ESG-Bewertung für diesen Fonds. Die Anlageverwaltung verfolgte dennoch die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) nach und beobachtete diese.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Reichweite 1 USD	tCO2e	614,21	52,01%
THG-Emissionen: Reichweite 2 USD	tCO2e	96,93	52,01%
THG-Emissionen: Reichweite 3 USD	tCO2e	4 528,73	52,01%
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	5 239,87	52,01%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	659,07	52,01%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 264,74	59,27%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	6,17%	53,69%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	77,91%	28,22%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	150,63	26,89%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	2,28	26,89%
Intensität des Energieverbrauchs: Fertigung (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,39	26,89%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	6,24	26,89%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,00	26,89%
Intensität des Energieverbrauchs: Bauwesen (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	32,12	26,89%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,06	26,89%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,97	26,89%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	0,00	26,89%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	53,69%
Emissionen in Wasser (USD)	Metrische Tonnen (USD)	1 675,15	0,25%
Gefährliche Abfälle (USD)	Metrische Tonnen (USD)	0,73	11,82%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	54,56%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	42,84%	53,69%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	24,79%	10,60%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	33,17%	50,64%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	53,69%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	385,27	35,82%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	35,82%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
US TREASURY FRN FLT 01/31/25	Staatsanleihen	20,69%	USA
COLOMBIA TES 7% 03/26/31	Staatsanleihen	4,64%	Kolumbien
STAGR 2021-DNA7 M2 FLT 11/25/41 144A	Hypothekensanleihen	3,81%	USA
UK TSY GILT 3.75% 10/22/53	Staatsanleihen	2,89%	Vereinigtes Königreich
MEXICAN BONOS 8% 07/31/53	Staatsanleihen	2,17%	Mexiko
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/33	Staatsanleihen	1,84%	Brasilien
FNCL MA4733 4.5% 09/01/52	Hypothekensanleihen	1,54%	USA
INT BK RECON&DEV 5% 01/22/26	Staatsanleihen	1,41%	Supranationale
INT BK RECON&DEV 4.25% 01/22/26	Staatsanleihen	1,37%	Supranationale
XP INC 3.25% 07/01/26 144A	Finanzsektor	1,34%	Brasilien
FIRST QUANTUM 6.875% 10/15/27 144A	Grundstoffe	1,33%	Kanada
GOLDMAN SACHS GP VAR 02/12/26	Finanzsektor	1,33%	USA
AES PANAMA GENER 4.375% 05/31/30	Versorgungsunternehmen	1,31%	Panama
FEDEX CORP 0.45% 05/04/29	Industrie	1,29%	USA
VOLVO CAR AB 2.5% 10/07/27	Zyklische Konsumgüter	1,27%	Zyklische Konsumgüter



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

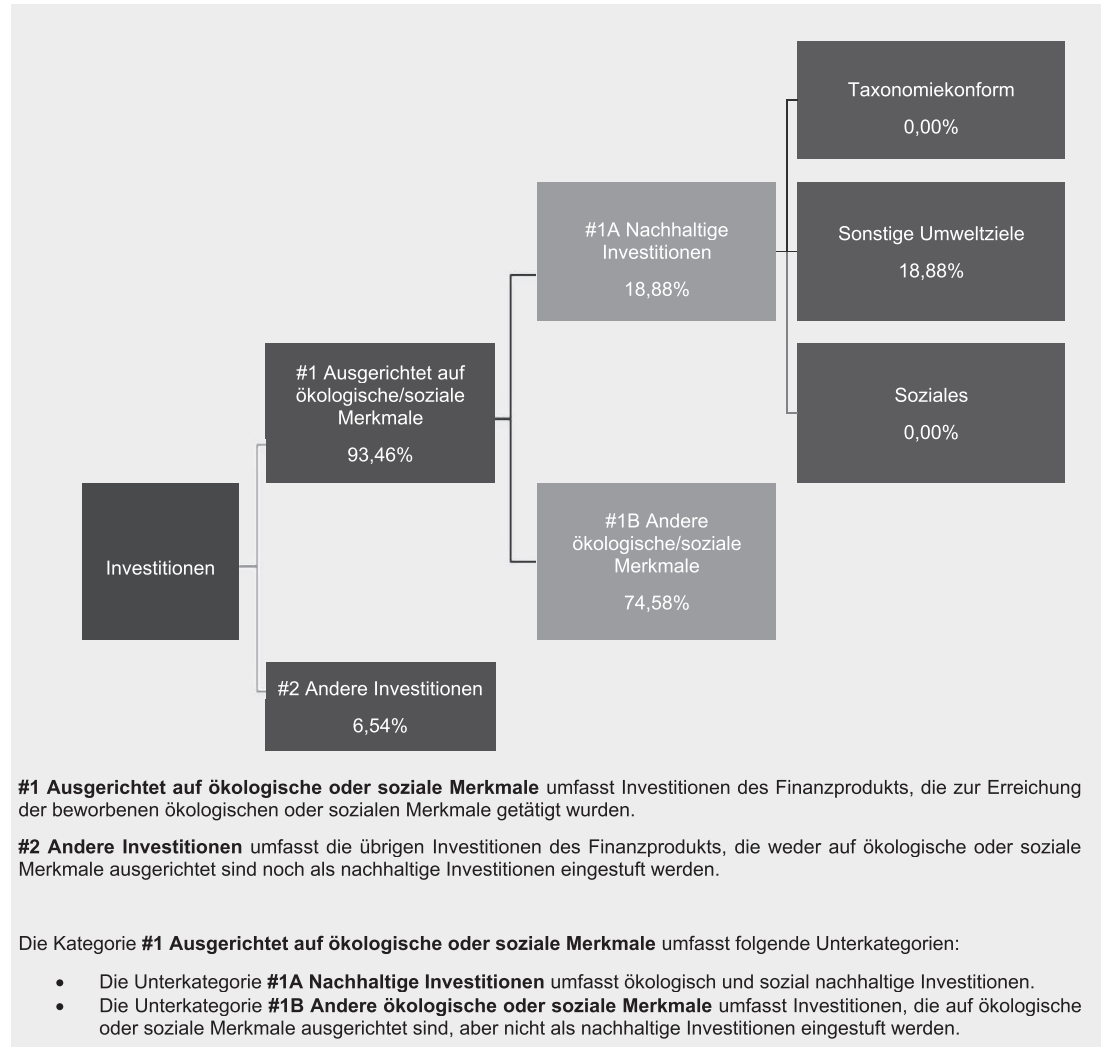
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 18,88 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

93,46 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (6,54 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Für das Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 18,88 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatlich	39,90%
Hypothekenspanpapiere	12,39%
Energie	11,79%
Finanzen	10,18%
Zyklische Konsumgüter	5,03%
Industrie	4,71%
Nichtzyklische Konsumgüter	3,68%
Grundstoffe	3,48%
Versorgungsunternehmen	1,31%
Technologie	1,23%
Kommunikation	0,29%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Oil Comp-Explor&Prodtn	6,35%
Diversifizierte Kreditinstitute	5,47%
WL Collat CMO Mezzanine	4,74%
WL Collat CMO Subordinat	4,27%
Automobil-Pkw/kleine Lkw	3,51%
UMBS Single Family 30Yr	3,39%
Supranationale Bank	2,77%
Metall-Kupfer	2,49%
Pipelines	2,19%
Medizin-Krankenhäuser	1,85%
Fluggesellschaften	1,53%
Container-Papier/Kunststoff	1,52%
Handelsbanken außerhalb der USA	1,50%
Finanzen-Investitionen Bnkr/Brkr	1,38%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

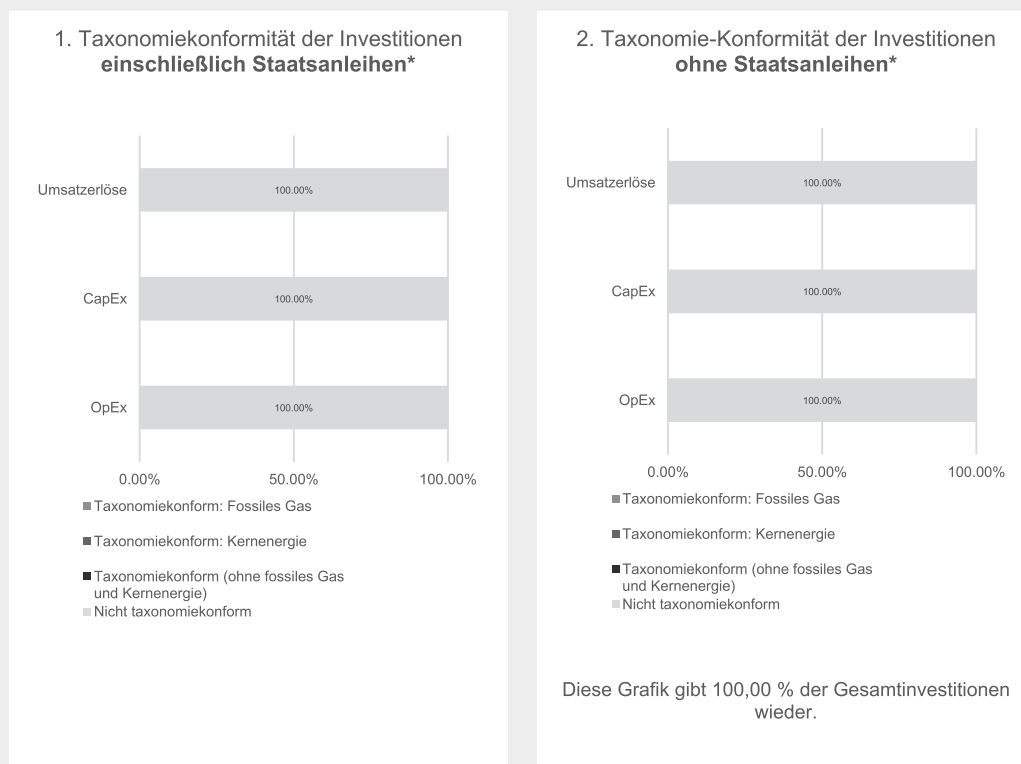
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

An nicht mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen mit einem Umweltziel wies das Finanzprodukt folgenden Anteil auf: 18,88%.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

An Investitionen mit einem sozialen Ziel wies das Finanzprodukt folgenden Anteil auf: 0,00%.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Das Finanzprodukt wies einen Anteil von 6,54%% an Investitionen auf, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen: JBS Foods, Concrete Pumping Holdings, Inc.
2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., Mexiko, Devon Energy Corporation, Kolumbien, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, Republik Südafrika, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasilien, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.
3. Der Fonds investierte mehr als 15 % seines Nettovermögens in nachhaltige Anlagen mit ökologischen/sozialen Zielen, siehe oben.
4. Wir werden die KPIs bei jedem Emittenten auch weiterhin verfolgen und im Auge behalten. Eine Verbesserung der KPIs wird über einen Zeitraum von zwei Jahren angestrebt. Dieser Fonds wurde im Dezember 2022 aufgelegt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge Value Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300OZGGIQZ97B7W66



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 30,40% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen.

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale umfassten:

- Umweltfaktoren, wie die ökologischen Praktiken eines Unternehmens, Treibhausgasemissionen (THG) und auf Energieeffizienz bezogene Initiativen;
- Soziale Faktoren wie den Ansatz eines Unternehmens in Bezug auf die Beziehungen zum gesellschaftlichen Umfeld, die Sicherheit und den Gesundheitsschutz am Arbeitsplatz sowie die Zuverlässigkeit und Preisgestaltung von Dienstleistungen

Im Hinblick auf seine Investments hielt der Fonds seine Verpflichtung ein, mindestens 5 % in „nachhaltige Anlagen“ zu investieren.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Der Anteil (30,4 %) der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der eigenen Methodik für nachhaltige Investitionen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDG“). Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Alle nachteiligen Auswirkungen (PAI), die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung sind, insbesondere PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den UN Global Compact und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.
- Der Prozentsatz des Portfolios mit einem Rating von B laut des eigenen ESG-Ratingsystems des Anlageverwalters,

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- das bei 1 % lag.
- Firmeneigene Methoden, um die Fortschritte der ESG-Engagement-Meetings des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Der Fond fällt in das Netto-Null-Ziel von ClearBridge und wurde in Bezug auf den Anteil der Unternehmen bewertet, die sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt bzw. sich dazu verpflichtet haben oder Lösungen zum Thema Klima anbieten; 45 %

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	34,79%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	10,25%

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
Netto-Null-Ausrichtung	Wert 34,79%	Wert 20,65%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	Wert 10,25%	Wert 16,06%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	827 154,00	96,33%	747 211,99	96,45%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	869,81	96,33%	877,12	96,45%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 708,04	96,33%	1 977,90	98,96%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,75%	0,00%	98,96%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	36,65%	92,03%	34,34%	94,40%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,03%	0,00%	94,40%

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu einem oder beiden der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der Ziele der UN für nachhaltige Entwicklung (SDG) und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitragen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 7,2 % des

Portfolios

- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in all ihren Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder Unternehmen, die Klimalösungen anbieten. Die Emittenten wurden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 27 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierendem Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wichtigen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Bewertung in Bezug auf gute Unternehmensführung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings des Anlageverwalters berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Umfeld, die geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren. Die

Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten.

Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendete Daten von Drittanbietern für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die Umsätze generieren aus (a) ausgeschlossenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) dem Übereinkommen über das Verbot von Streumunition und (b) Waffen, die als B- oder C-Waffen gemäß dem Biowaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen bzw. dem Chemiewaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen eingestuft sind.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	827 154,00	96,33%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	869,81	96,33%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 708,04	96,33%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,75%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	36,65%	92,03%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,03%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP, INC.	Finanzsektor	2,83%	USA
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitssektor	2,69%	USA
ORACLE CORPORATION	Informationstechnologie	2,48%	USA
FREEMPORT-MCMORAN INC.	Grundstoffe	2,34%	USA
NOBLE CORPORATION PLC	Energie	2,32%	USA
MICRON TECHNOLOGY, INC.	Informationstechnologie	2,24%	USA
META PLATFORMS, INC.	Kommunikationsdienste	2,12%	USA
UBER TECHNOLOGIES, INC.	Industrie	2,10%	USA
VISTRA CORP.	Versorgungsunternehmen	2,10%	USA
EQT CORPORATION	Energie	2,02%	USA
FISERV, INC.	Finanzsektor	1,99%	USA
THE GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	Finanzsektor	1,82%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Gesundheitssektor	1,81%	USA
CAPITAL ONE FINANCIAL CORPORATION	Finanzsektor	1,78%	USA
CONSTELLATION ENERGY CORPORATION.	Versorgungsunternehmen	1,78%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

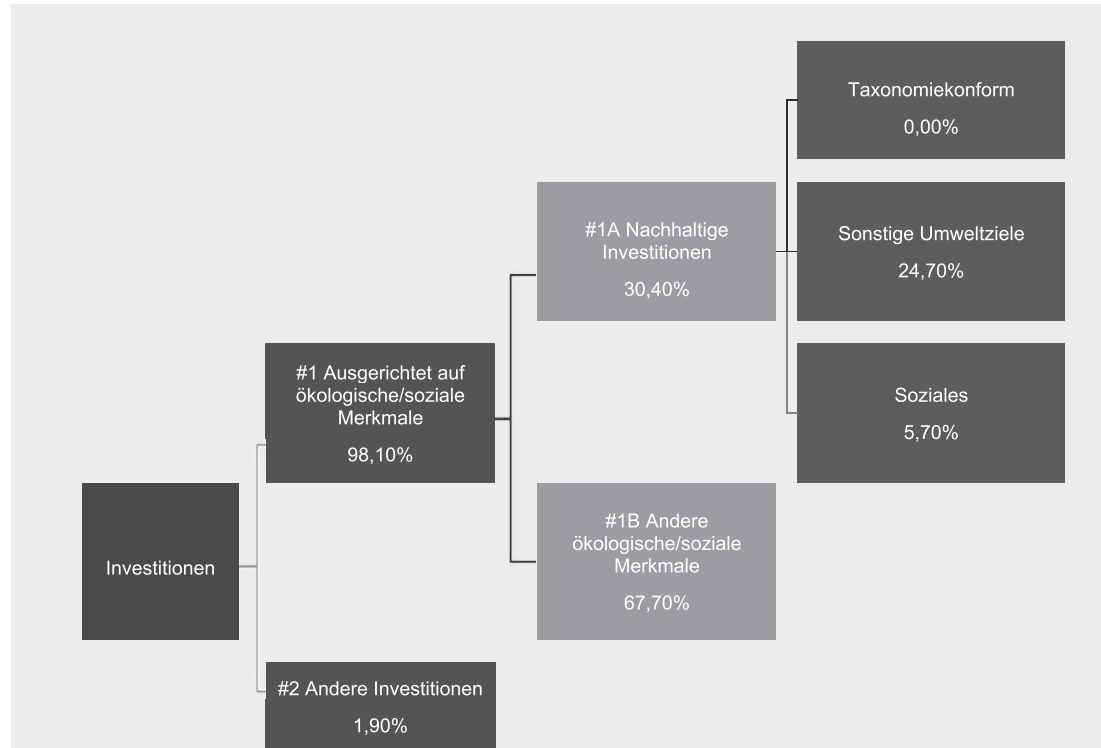
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 30,4 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 98,1 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,9 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 30,4 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	21,31%
Energie	13,90%
Industrie	13,51%
Gesundheitssektor	13,19%
Informationstechnologie	8,16%
Versorgungsunternehmen	7,75%
Grundstoffe	6,63%
Zyklische Konsumgüter	4,69%
Basiskonsumgüter	4,12%
Kommunikationsdienste	2,54%
Immobilien	2,07%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	8,94%
Finanzdienstleistungen	8,57%
Biotechnologie	5,79%
Energieausrüstung und -dienstleistungen	4,96%
Versicherungen	4,52%
Metalle u. Bergbau	4,23%
Halbleiter u. Halbleiterrausrüstung	4,12%
Banken	4,11%
Überlandtransport	4,10%
Software	4,04%
Stromversorger	3,86%
Pharma	3,78%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	3,64%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	3,18%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,79%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

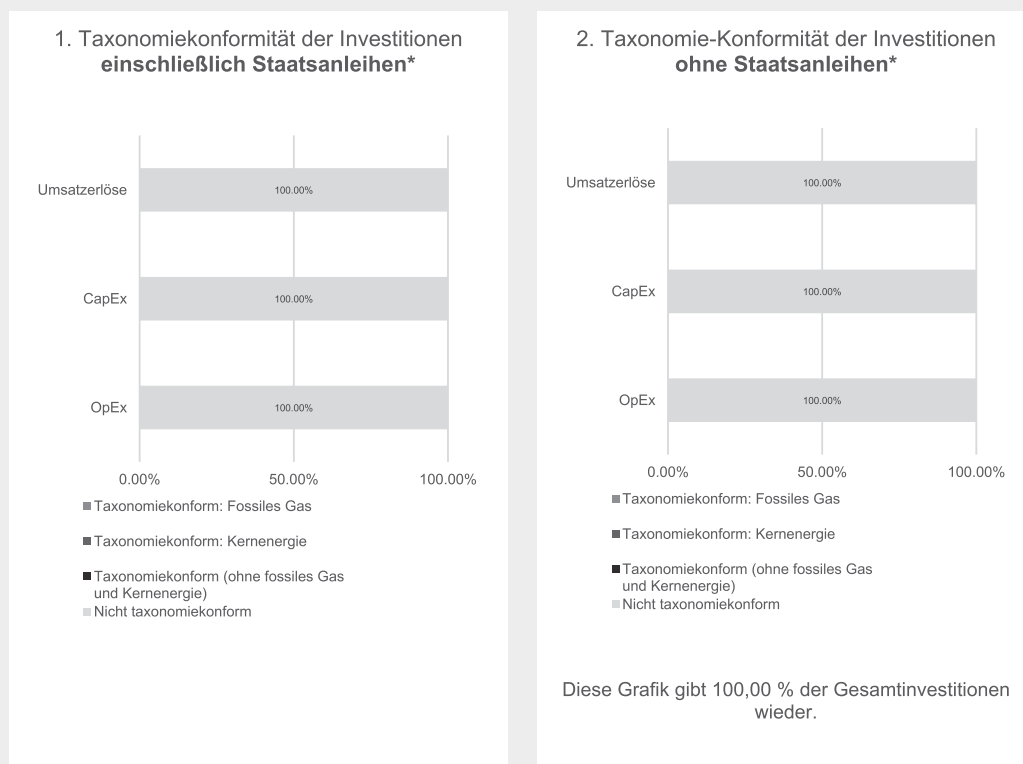
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2024 Investitionen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 24,7 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 5,7 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,9 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:

AAA: 12 %

AA: 60 %

A: 25 %

B: 1 %

2. Der Anlageverwalter stand mit seinen Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Darüber hinaus tauschte sich der Anlageverwalter regelmäßig direkt mit den Unternehmen mit einem B-Rating, in die der Fonds investiert, aus, um die wesentlichen ökologischen und/oder sozialen Merkmale dieser Unternehmen zu verbessern.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://frankintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300SQ18HYQNNQ20536



**FRANKLIN
TEMPLETON**

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 65,31% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren wesentliche Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehörten unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 5 % an „nachhaltigen Investitionen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Der Anteil (65,3 %) der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der eigenen Methodik für nachhaltige Investitionen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDG“). Diese Art der Investitionen lag bei 25 %. Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Bestimmte Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI-Indikatoren), und zwar: PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO2-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den Global Compact der Vereinten Nationen und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.
- Firmeneigene Methoden, um die Fortschritte der ESG-Engagement-Meetings des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 24.2.2024 wie folgt aus:
 - AAA: 38 %
 - AA: 43 %
 - A: 17 %
 - B: 0 %

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	74 995,40	98,83%	67 906,15	95,72%
CO ₂ -Bilanz (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. \$	377,30	98,83%	381,67	95,72%
THG-Intensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. \$ Umsatz	1 066,81	98,83%	886,78	95,72%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,16%	98,83%	0,00%	95,72%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	36,13%	98,83%	35,65%	95,72%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,83%	0,00%	95,72%

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 25,08 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in all ihren Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder Unternehmen, die Klimalösungen anbieten. Die Emittenten werden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 47 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt,

ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilssektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings des Anlageverwalters berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Umfeld, die geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren. Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten.

Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung kann auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durchführen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Treminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	74 995,40	98,83%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	377,30	98,83%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 066,81	98,83%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,16%	98,83%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	36,13%	98,83%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,83%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	8,84%	USA
APPLE INC.	Informationstechnologie	6,29%	USA
ALPHABET INC.	Kommunikationsdienste	3,58%	USA
AMAZON.COM, INC.	Zyklische Konsumgüter	3,17%	USA
VISA INC.	Finanzsektor	2,99%	USA
BERKSHIRE HATHAWAY INC.,	Finanzsektor	2,72%	USA
MERCK & CO., INC.	Gesundheitssektor	2,67%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Gesundheitssektor	2,65%	USA
THE TJX COMPANIES, INC.	Zyklische Konsumgüter	2,43%	USA
JPMORGAN CHASE & CO.	Finanzsektor	2,43%	USA
NVIDIA CORPORATION	Informationstechnologie	2,25%	USA
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	Industrie	2,25%	USA
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitssektor	2,10%	USA
The Travelers Companies, Inc.	Finanzsektor	2,02%	USA
ELI LILLY AND COMPANY	Gesundheitssektor	1,88%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

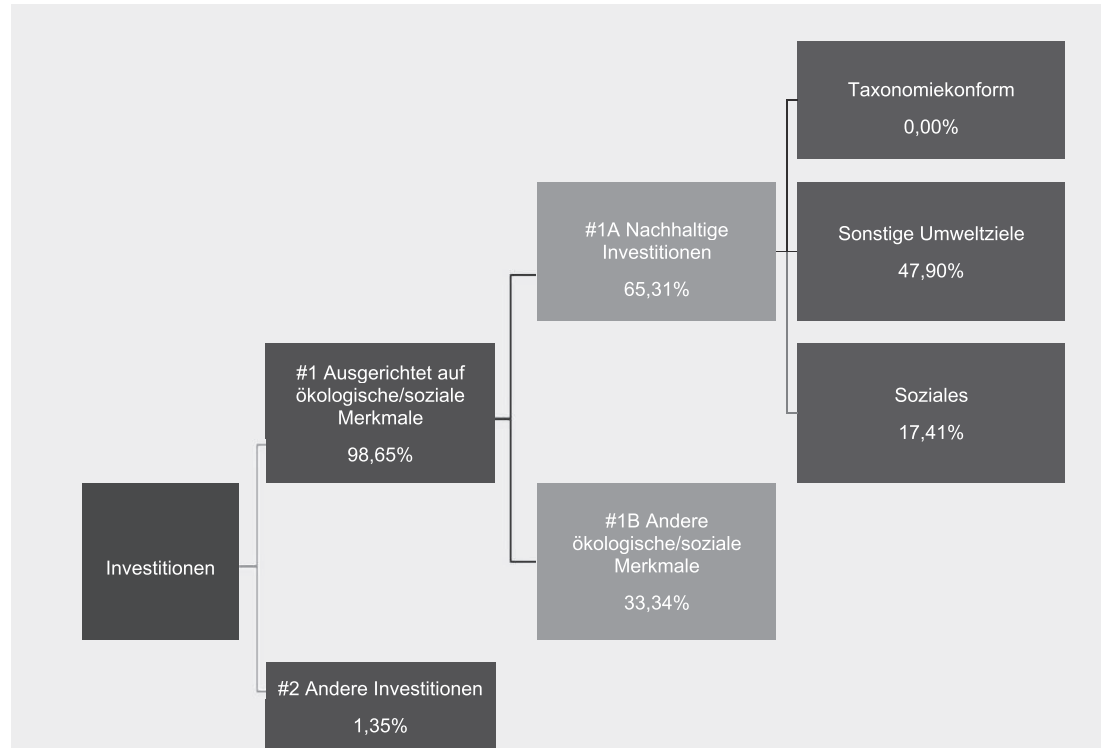
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 65,31 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 98,65 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,35 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 65,31 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	23,01%
Finanzsektor	16,89%
Gesundheitssektor	14,98%
Industrie	10,62%
Kommunikationsdienste	8,62%
Basiskonsumgüter	7,25%
Zyklische Konsumgüter	6,85%
Grundstoffe	6,26%
Energie	1,99%
Versorgungsunternehmen	1,20%
Immobilien	1,17%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Software	12,17%
Pharma	7,25%
Finanzdienstleistungen	6,77%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	6,29%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	5,01%
Banken	4,29%
Chemische Erzeugnisse	4,15%
Versicherungen	4,02%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	3,80%
Fachhandel	3,68%
Allgemeiner Einzelhandel	3,17%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,65%
Getränke	2,59%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	2,44%
Elektronikgeräte	2,33%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

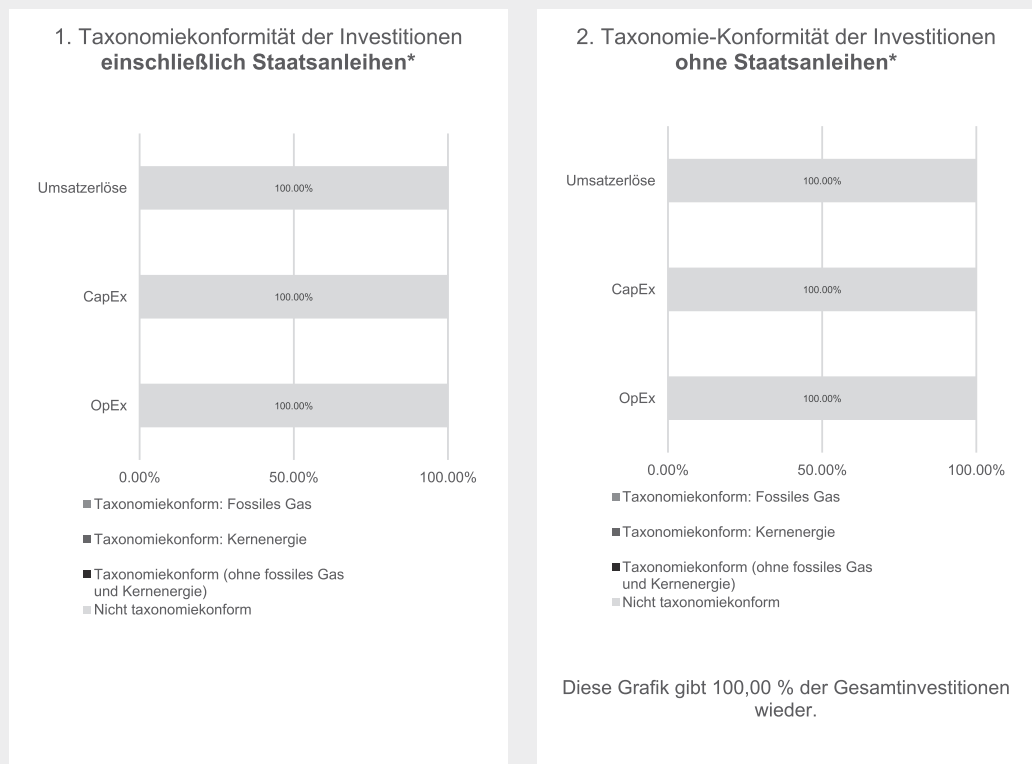
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2024 Investitionen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 47,9 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 17,41 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,35 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:

AAA: 38 %

AA: 43 %

A: 17 %

B: 0 %

2. Der Anlageverwalter stand mit seinen Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen eines oder mehrere der zehn Prinzipien in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493003YRBLHS9UVBW79



**FRANKLIN
TEMPLETON**

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 79,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren wesentliche Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehörten unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 20 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Der Anteil (79 %) der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der eigenen Methodik für nachhaltige Investitionen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDG“). Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Alle nachteiligen Auswirkungen (PAI), nämlich PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den UN Global Compact und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.
- eigene Methoden, um den Fortschritt der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßige ESG-Engagement-Meetings mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Anlageverwaltung. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 20.2.2024 wie folgt aus:

- AAA: 46 %
- AA: 39 %
- A: 13 %
- B: 0 %

Der Fonds gehört zum Netto-Null-Ziel von ClearBridge und wurde in Bezug auf den Anteil der Unternehmen, die sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt bzw. sich dazu verpflichtet haben oder Lösungen zum Thema Klima anbieten, bewertet; 76 %

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	59,73%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	16,36%

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
Netto-Null-Ausrichtung	Wert 59,73%	Wert 44,24%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	Wert 16,36%	Wert 23,62%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	151 372,00	97,27%	106 503,87	95,26%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	94,84	97,27%	97,02	95,26%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	379,30	97,27%	465,22	95,26%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,27%	0,00%	95,26%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	35,78%	96,64%	34,89%	95,26%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,64%	0,00%	95,26%

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 44 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in all ihren

Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder Unternehmen, die Klimalösungen anbieten. Die Emittenten wurden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 52 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilssektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings des Anlageverwalters berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Umfeld, die geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren. Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten.

Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens

insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendete Daten von Drittanbietern für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Treminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	151 372,00	97,27%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	94,84	97,27%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	379,30	97,27%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,27%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	35,78%	96,64%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,64%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	8,30%	USA
AMAZON.COM, INC.	Zyklische Konsumgüter	7,34%	USA
NVIDIA CORPORATION	Informationstechnologie	7,13%	USA
VISA INC.	Finanzsektor	4,87%	USA
META PLATFORMS, INC.	Kommunikationsdienste	4,71%	USA
APPLE INC.	Informationstechnologie	4,62%	USA
NETFLIX, INC.	Kommunikationsdienste	3,43%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Gesundheitssektor	3,18%	USA
PALO ALTO NETWORKS, INC.	Informationstechnologie	2,51%	USA
SALESFORCE, INC.	Informationstechnologie	2,46%	USA
W.W. GRAINGER, INC.	Industrie	2,39%	USA
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	Gesundheitssektor	2,26%	USA
ADOBE INC.	Informationstechnologie	2,20%	USA
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	Industrie	2,20%	USA
S&P GLOBAL INC.	Finanzsektor	2,13%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

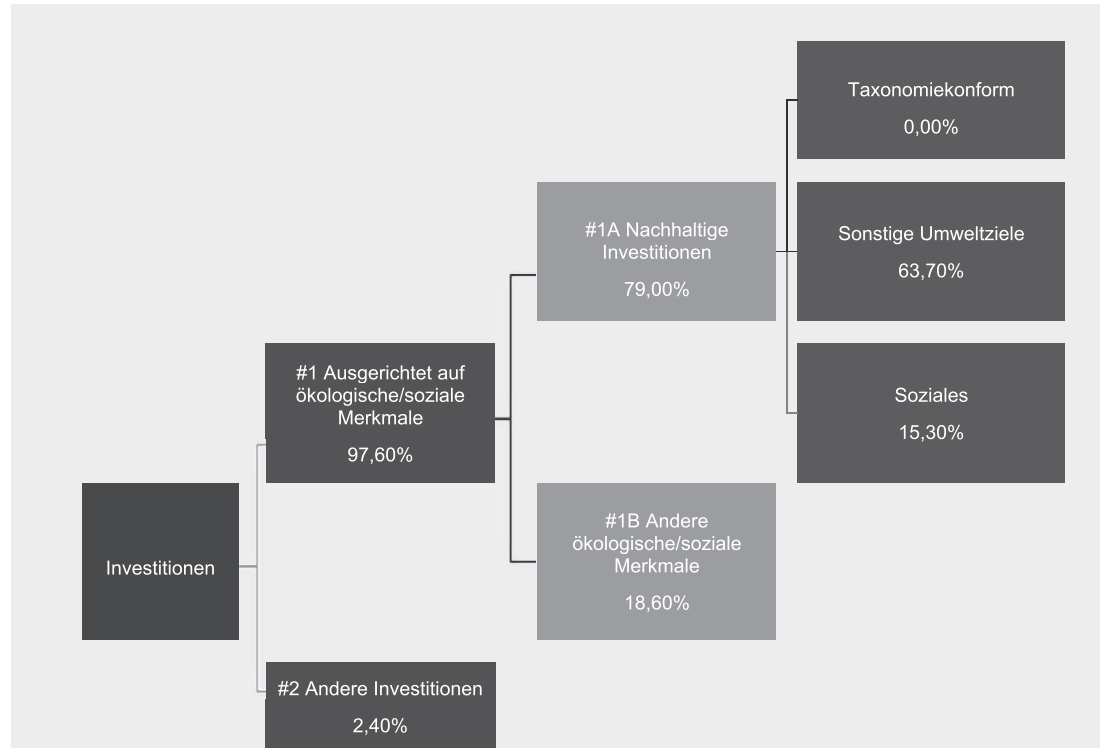
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 79,0 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 97,6 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,4 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 79,0 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	34,87%
Gesundheitssektor	14,72%
Zyklische Konsumgüter	10,54%
Industrie	10,41%
Finanzsektor	10,04%
Kommunikationsdienste	8,34%
Basiskonsumgüter	4,00%
Grundstoffe	1,75%
Immobilien	1,57%
Versorgungsunternehmen	1,04%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Software	20,34%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	9,90%
Allgemeiner Einzelhandel	7,34%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	6,31%
Finanzdienstleistungen	6,03%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	4,71%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	4,62%
Unterhaltung	3,64%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,18%
Pharma	2,96%
Überlandtransport	2,96%
Kapitalmärkte	2,42%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	2,39%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	2,26%
Elektronikgeräte	2,20%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

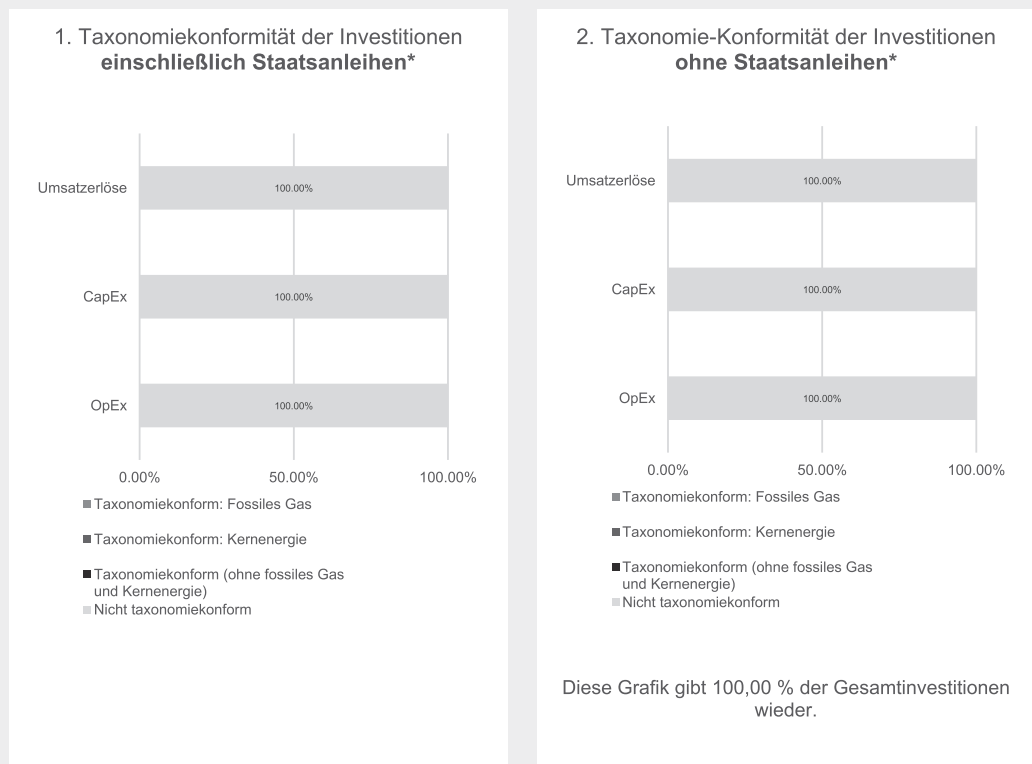
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2024 Investitionen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 63,7 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 15,3 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 2,4 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:

AAA: 46 %

AA: 39 %

A: 13 %

B: 0 %

2. Der Anlageverwalter stand mit seinen Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493007ZJMPVPNDQMY52



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 50,90% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren wesentliche Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehörten unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 5 % an „nachhaltigen Investitionen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Der Anteil (50,9 %) der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der eigenen Methodik für nachhaltige Investitionen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDG“). Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Bestimmte Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI-Indikatoren), und zwar: PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO2-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den Global Compact der Vereinten Nationen und OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.
- eigene Methoden, um den Fortschritt der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßige ESG-Engagement-Meetings mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Anlageverwaltung. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:
- AAA: 27 %
- AA: 52 %
- A: 20 %
- B: 0 %

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	25 360,40	98,48%	137 578,85	98,79%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	121,15	98,48%	667,17	98,79%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	330,68	98,48%	9 124,64	98,79%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,48%	0,00%	98,79%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	33,59%	97,85%	31,64%	98,79%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,85%	0,00%	98,79%

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 27,7 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in all ihren Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder Unternehmen, die Klimalösungen anbieten. Die Emittenten werden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 41 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierendem Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt,

ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilssektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings des Anlageverwalters berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Umfeld, die geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren. Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten.

Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretninen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	25 360,40	98,48%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	121,15	98,48%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	330,68	98,48%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,48%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	33,59%	97,85%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,85%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
BROADCOM INC.	Informationstechnologie	8,71%	USA
VERTEX PHARMACEUTICALS INCORPORATED	Gesundheitssektor	7,68%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Gesundheitssektor	7,25%	USA
AUTODESK, INC.	Informationstechnologie	5,73%	USA
CROWDSTRIKE HOLDINGS, INC.	Informationstechnologie	5,38%	USA
TE Connectivity Ltd.	Informationstechnologie	5,07%	USA
HUBSPOT, INC.	Informationstechnologie	4,74%	USA
COMCAST CORPORATION	Kommunikationsdienste	4,56%	USA
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	Industrie	3,19%	USA
MADISON SQUARE GARDEN SPORTS CORP.	Kommunikationsdienste	3,14%	USA
BIOGEN INC.	Gesundheitssektor	3,00%	USA
FORMULA ONE GROUP	Kommunikationsdienste	2,17%	USA
AIRBNB, INC.	Zyklische Konsumgüter	2,14%	USA
SNOWFLAKE INC.	Informationstechnologie	2,14%	USA
ABBVIE INC.	Gesundheitssektor	2,13%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

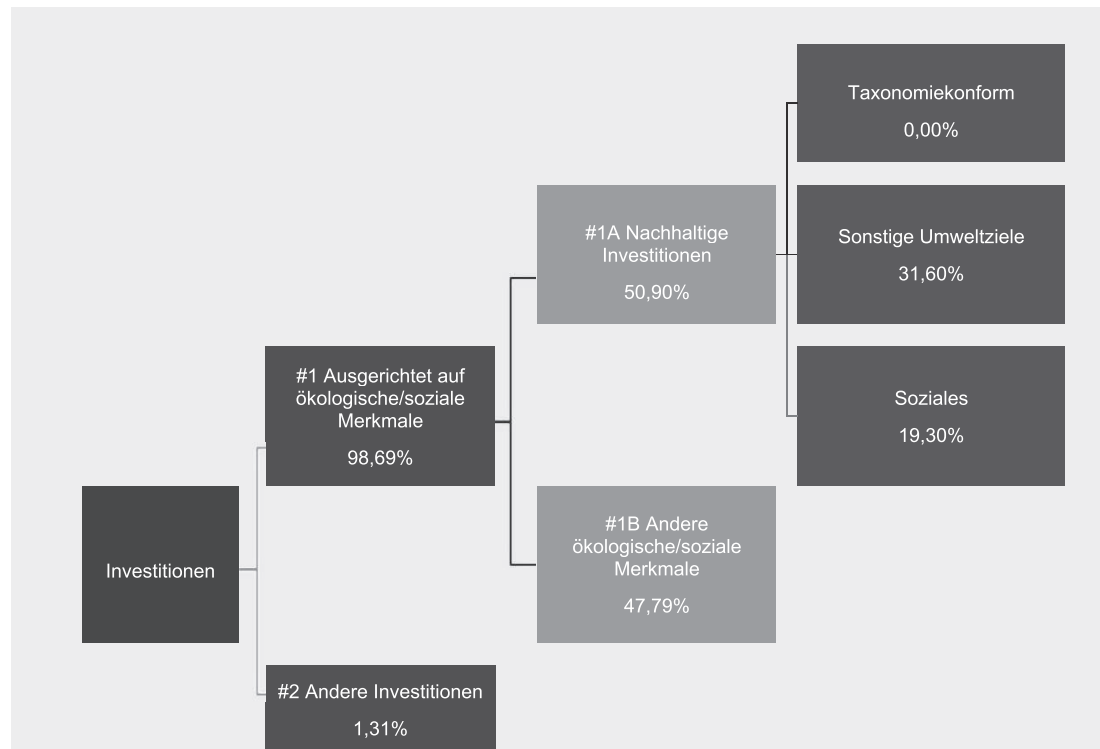
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 50,9 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 98,69 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,31 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 50,9 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	41,62%
Gesundheitssektor	27,49%
Kommunikationsdienste	14,64%
Zyklische Konsumgüter	6,06%
Industrie	4,34%
Grundstoffe	1,87%
Basiskonsumgüter	1,85%
Finanzsektor	0,62%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Software	19,30%
Biotechnologie	15,82%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	10,69%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	7,30%
Unterhaltung	6,92%
Elektronische Ausrüstung, Geräte u. Komponenten	5,07%
Medien	4,99%
IT-Dienstleistungen	4,42%
Baustoffe	3,19%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	2,90%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	2,74%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	2,13%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	1,99%
Metalle u. Bergbau	1,87%
Getränke	1,79%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

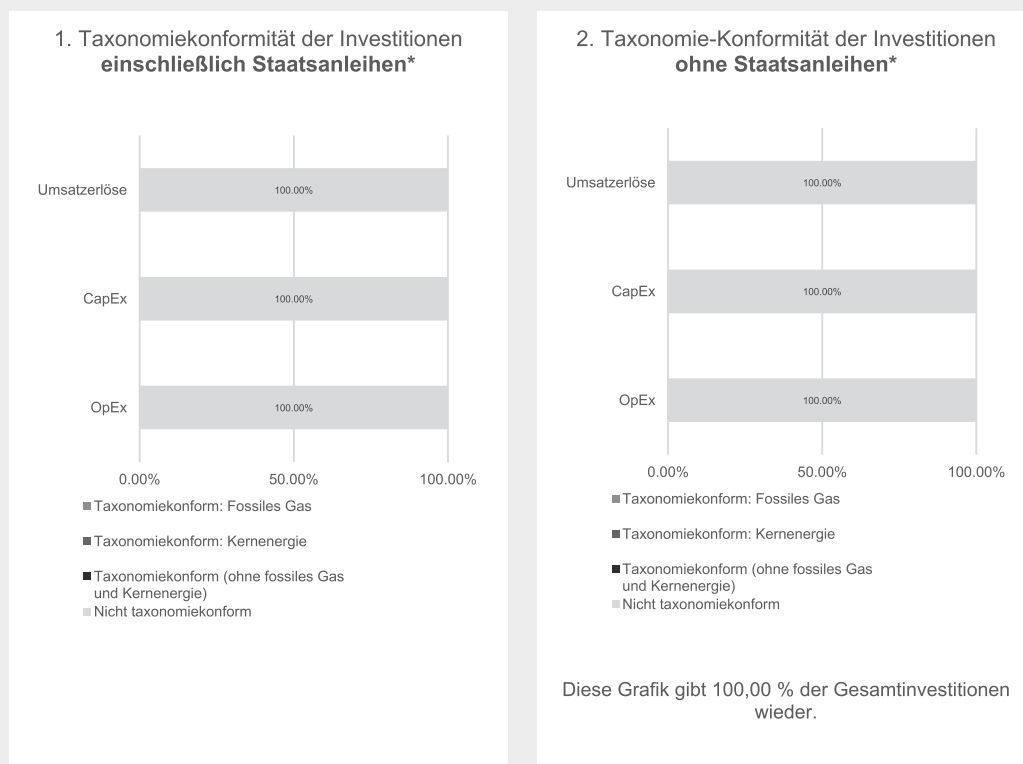
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2024 Investitionen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 31,6 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 19,3 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,31 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:

- AAA: 27 %
- AA: 52 %
- A: 20 %
- B: 0 %

2. Der Anlageverwalter stand mit seinen Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund (der „Fonds“)



FRANKLIN
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300RLIXEW79ZFOB12

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 85,40% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Berichtszeitraums investierte die Anlageverwaltung als Teil ihrer Anlagepolitik in Unternehmen mit unterschiedlicher Marktkapitalisierung und unterstützte somit starke oder sich verbessernde ökologische, soziale und Governance- („ESG“) Merkmale. Der Fonds ermittelt anhand eines etablierten, eigenen Research- und Engagement-Prozesses, ob ein Unternehmen ein Sustainability Leader ist. Dieser firmeneigene Prozess ergibt ein ESG-Ratingsystem, das eine Wesentlichkeitskarte benutzt, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Diese Merkmale umfassten unter anderem:

- Energieeffizienz,
- saubere Energie,
- Technologien zur Senkung der CO₂-Emissionen,
- Wassereffizienz,
- Prozesse zur Reduzierung von Materialabfall,
- Vielfalt in der Belegschaft,
- Gesundheit und Wohlergehen,
- Lohngerechtigkeit,
- Überwachung der Lieferkette sowie
- gemeinnütziges Engagement.

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 50 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Der Anteil (85,4 %) der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der eigenen Methodik für nachhaltige Investitionen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDG“). Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Spezifische Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal adverse impact, „PAI“), nämlich

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind), PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

- Firmeneigene Methoden, um die Fortschritte der ESG-Engagement-Meetings des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Das Engagement des Portfolios bei Best-in-Class-Emittenten, wie es mit dem firmeneigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung definiert wurde. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds beträgt mit Stand vom 29.2.2024:
 - AAA: 64 %
 - AA: 35 %
 - A: 1 %
 - B: 0 %
- Der Fonds gehört zum Netto-Null-Ziel von ClearBridge und wurde in Bezug auf den Anteil der Unternehmen bewertet, die sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt bzw. sich dazu verpflichtet haben oder Lösungen zum Thema Klima anbieten; 78 %

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	57,41%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	20,46%

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
Netto-Null-Ausrichtung	Wert	Wert
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	57,41%	50,51%
	20,46%	12,07%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	818 685,00	98,78%	1 514 149,99	98,66%
CO ₂ -Bilanz (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. \$	544,28	98,78%	973,99	98,66%
THG-Intensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. \$ Umsatz	1 268,29	99,07%	1 881,15	98,66%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	4,54%	98,39%	3,78%	98,66%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,39%	0,00%	98,66%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,07%	0,00%	98,66%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	36,50%	98,39%	34,46%	98,66%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,39%	0,00%	98,66%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapieren, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu einem der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 59 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in all ihren Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder Unternehmen, die Klimalösungen anbieten. Die Emittenten werden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 44 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele müssen die Unternehmen eine eigene Bewertung im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung durchlaufen und die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm) erfüllen, wie weiter unten beschrieben.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

----- **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen,

oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.
Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings des Anlageverwalters berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Umfeld, die geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren. Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten.

Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind)

Der Fonds investierte nicht in ein Unternehmen, dessen Hauptgeschäft mit der Gewinnung von fossilen Brennstoffen verbunden ist.

PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken)

Obwohl der Fonds derzeit keine offiziellen Schwellenwerte für Ausschüsse im Zusammenhang mit der biologischen Vielfalt hat, wurde dieser Aspekt bei der allgemeinen Umwelt- und Klimafolgenabschätzung für Investitionen und potenzielle Investitionen des Fonds berücksichtigt. Der Fonds erwartet, dass alle Unternehmen, in die er investiert, ein positives Profil in Bezug auf die biologische Vielfalt aufweisen. Verstöße können zum Anlageausschluss führen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Treminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen, Streumunition, weißer Phosphor).

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	818 685,00	98,78%
CO ₂ -Bilanz (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. \$	544,28	98,78%
THG-Intensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. \$ Umsatz	1 268,29	99,07%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	4,54%	98,39%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,39%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,07%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	36,50%	98,39%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,39%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	8,36%	USA
APPLE INC.	Informationstechnologie	5,89%	USA
JPMORGAN CHASE & CO.	Finanzsektor	3,02%	USA
ALPHABET INC.	Kommunikationsdienste	2,97%	USA
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	Industrie	2,93%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Gesundheitssektor	2,74%	USA
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	Basiskonsumgüter	2,71%	USA
THE HOME DEPOT, INC.	Zyklische Konsumgüter	2,25%	USA
VISA INC.	Finanzsektor	2,13%	USA
SALESFORCE, INC.	Informationstechnologie	1,98%	USA
BOOKING HOLDINGS INC.	Zyklische Konsumgüter	1,96%	USA
TRANE TECHNOLOGIES PLC	Industrie	1,91%	USA
DANAHER CORPORATION	Gesundheitssektor	1,88%	USA
NOVO NORDISK A/S	Gesundheitssektor	1,87%	Dänemark
CISCO SYSTEMS, INC.	Informationstechnologie	1,83%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

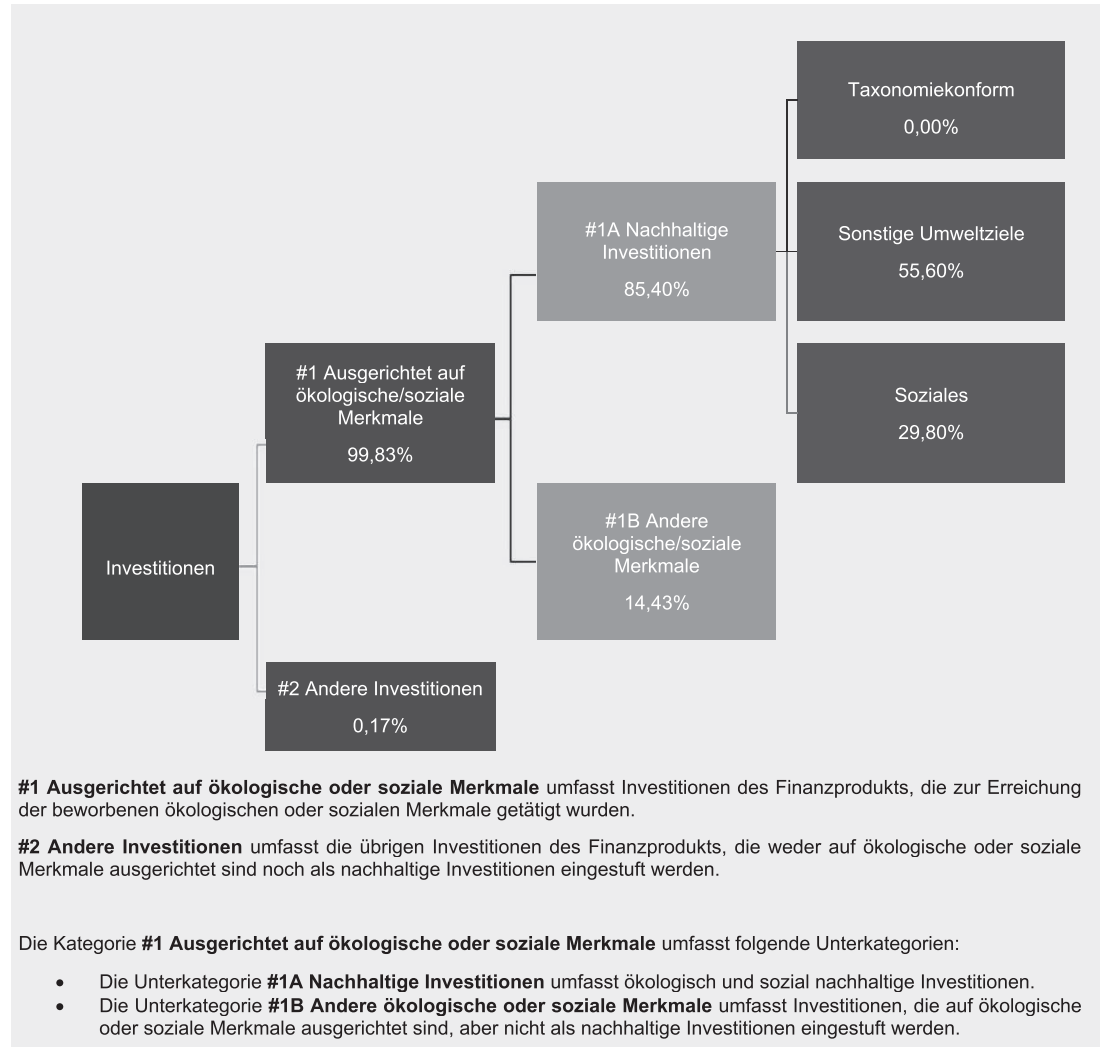
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 85,4 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 99,83 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,17 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 85,4 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	27,72%
Gesundheitssektor	16,92%
Finanzsektor	12,71%
Industrie	11,39%
Zyklische Konsumgüter	8,72%
Basiskonsumgüter	7,55%
Kommunikationsdienste	4,50%
Immobilien	3,32%
Grundstoffe	3,15%
Versorgungsunternehmen	3,10%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Software	11,95%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	6,08%
Elektronikgeräte	5,92%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	5,16%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	4,93%
Kapitalmärkte	4,16%
Fachhandel	3,76%
Pharma	3,59%
Baustoffe	3,44%
Haushaltsartikel	3,41%
Versicherungen	3,40%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	3,13%
Banken	3,02%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	2,97%
Biotechnologie	2,95%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

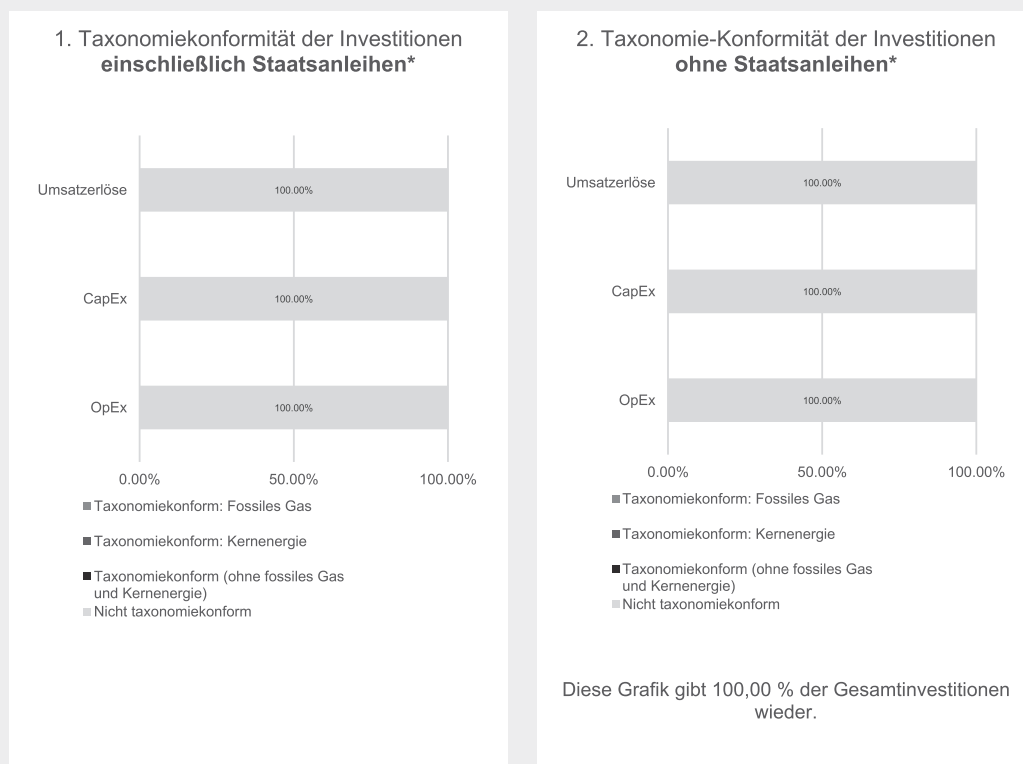
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Investitionen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 55,6 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 29,8 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 0,17 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um führende Unternehmen beim Thema Nachhaltigkeit zu identifizieren, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Anlageverwaltung betrachtet AAA und AA als „Best-in-Class“. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:

- AAA: 64 %
- AA: 35 %
- A: 1 %
- B: 0 %

2. Der Anlageverwalter stand mit seinen Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Fossile Brennstoffe
- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Konventionelle Waffen
- Kernkraft
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge Global Growth Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300S2ND6DHQ60NF78



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 63,60% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren wesentliche Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehörten unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 5 % an „nachhaltigen Investitionen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Der Anteil (63,6 %) der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der eigenen Methodik für nachhaltige Investitionen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDG“). Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Bestimmte Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI-Indikatoren), und zwar: PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO2-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den Global Compact der Vereinten Nationen und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.
- Firmeneigene Methoden, um die Fortschritte der ESG-Engagement-Meetings des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:
 - AAA: 34 %
 - AA: 52 %
 - A: 12 %
 - B: 0 %

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	1 144,23	97,96%	1 295,82	96,85%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	76,68	97,96%	104,70	96,85%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	314,95	97,96%	486,01	98,22%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,03%	0,00%	98,22%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	35,99%	97,20%	36,36%	95,59%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,20%	0,00%	95,59%

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds werden in Aktien von Unternehmen getätigt, die zu einem der folgenden Bereiche beitragen:

Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitragen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 17,7 %

Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in allen Wirtschaftstätigkeiten eines Unternehmens, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird. Die Emittenten werden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 45,7 %

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele müssen die Unternehmen eine eigene Bewertung im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung durchlaufen und die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm) erfüllen, wie weiter unten beschrieben.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren

anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings des Anlageverwalters berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Umfeld, die geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren. Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten.

Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung kann auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durchführen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretninen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	1 144,23	97,96%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	76,68	97,96%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	314,95	97,96%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,03%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	35,99%	97,20%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,20%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	5,02%	USA
APPLE INC.	Informationstechnologie	4,61%	USA
ELI LILLY AND COMPANY	Gesundheitssektor	3,20%	USA
AMAZON.COM, INC.	Zyklische Konsumgüter	3,06%	USA
ALPHABET INC.	Kommunikationsdienste	2,82%	USA
NVIDIA CORPORATION	Informationstechnologie	1,98%	USA
SAP SE	Informationstechnologie	1,97%	Deutschland
INTERCONTINENTAL EXCHANGE, INC.	Finanzsektor	1,97%	USA
MARVELL TECHNOLOGY, INC	Informationstechnologie	1,96%	USA
UNION PACIFIC CORPORATION	Industrie	1,90%	USA
S&P GLOBAL INC.	Finanzsektor	1,84%	USA
Deutsche Telekom AG	Kommunikationsdienste	1,83%	Deutschland
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	Gesundheitssektor	1,76%	USA
SALESFORCE, INC.	Informationstechnologie	1,72%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Gesundheitssektor	1,72%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

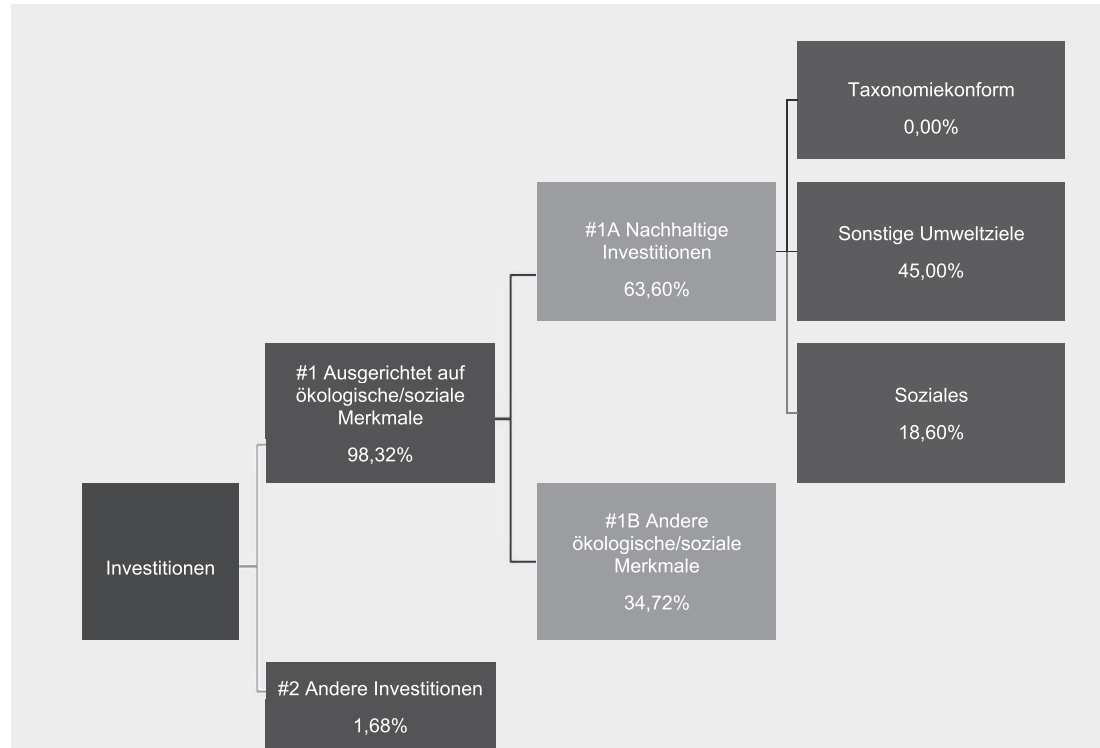
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 63,6 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 98,32 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,68 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 63,6 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	30,40%
Gesundheitssektor	16,93%
Zyklische Konsumgüter	11,23%
Finanzsektor	10,26%
Basiskonsumgüter	9,68%
Kommunikationsdienste	9,07%
Industrie	7,50%
Versorgungsunternehmen	2,02%
Grundstoffe	0,93%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Software	14,41%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	7,32%
Kapitalmärkte	7,03%
Pharma	4,96%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	4,71%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	4,61%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	4,56%
Allgemeiner Einzelhandel	4,21%
Produkte für den persönlichen Bedarf	4,14%
Biotechnologie	3,62%
Unterhaltung	2,67%
Überlandtransport	2,65%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	2,44%
IT-Dienstleistungen	2,20%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	2,11%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

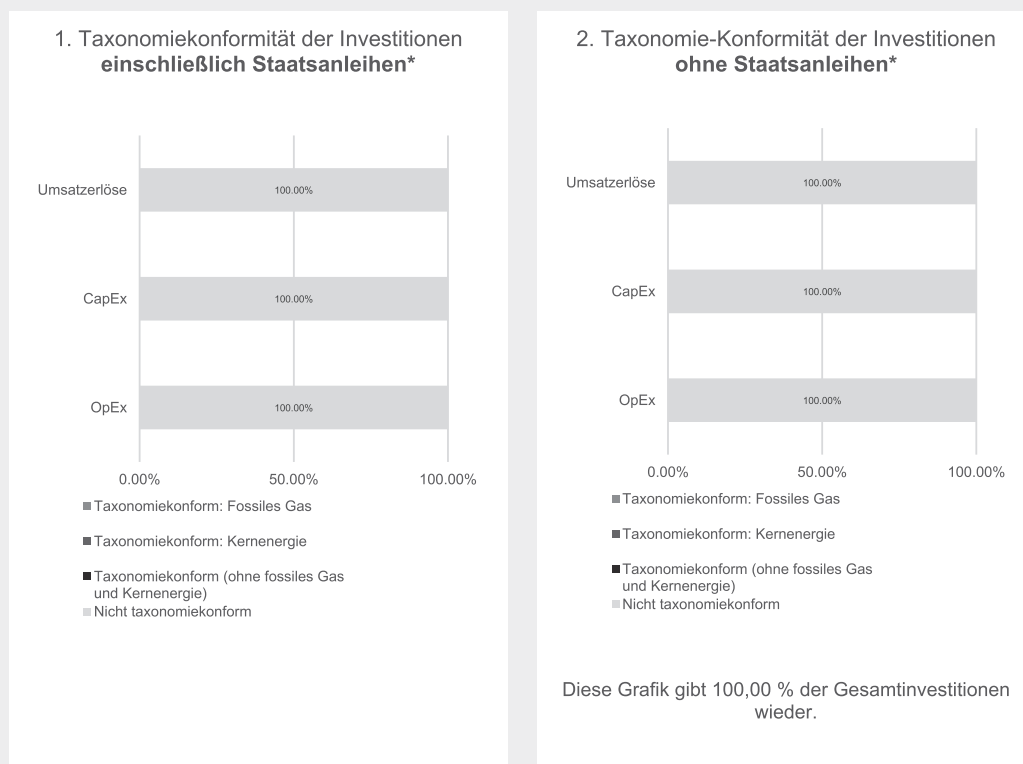
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2024 Investitionen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 45,00 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 18,6 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,68 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening guter Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:

AAA: 34 %

AA: 52 %

A: 12 %

B: 0 %

2. Der Anlageverwalter stand mit seinen Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300C63RJNQRH38W57



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 61,70% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte eine positive Wirkung im Hinblick auf:

- Klimaschutz,
- Anpassung an den Klimawandel und/oder
- gesellschaftliche Auswirkungen.

Die Unterstützung positiver Wirkungen in den oben genannten Bereichen führte dazu, dass der Fonds die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Referenzzeitraum förderte:

- Investitionen, die den Übergang zu einer CO2-armen Wirtschaft unterstützen, entweder durch direkte Reduzierung von Emissionen, Ermöglichung von Alternativen mit weniger Emissionen oder Bereitstellung von Ersatzprodukten mit geringeren Emissionen, oder durch Dienstleistungen für den Transport auf der Schiene statt Alternativen per Flugzeuge oder auf der Straße,
- Investitionen in Infrastrukturunternehmen, die die Anpassung an den Klimawandel unterstützen,
- Infrastruktur, die gesellschaftliche Auswirkungen unterstützt, wie die Bereitstellung eines gerechten Zugangs zu grundlegenden Dienstleistungen wie Zugang zu Wasser, Energie und Kommunikation, und
- Einhaltung der Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC).

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren umfasst ein ESG-Ratingsystem, das eine Wesentlichkeitskarte benutzt, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen.

Die Anlageverwaltung wendet ihren ESG-Prozess auf alle Anlagen im Berichtszeitraum an. Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 15 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen

oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- der Anteil der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der eigenen Methodik für nachhaltige Investitionen der Anlageverwaltung definiert sind (in diesem Fall betrug der Anteil 61,7 %) und
- das ESG-Rating des Fonds (7,35) im Vergleich zum ESG-Rating des Anlageuniversums (6,58), wie in der Tabelle unten ersichtlich.

Dort, wo die ESG-Punktzahlen auf MSCI-Daten beruhen, sind sie gleichgewichtet mit dem „ESG-Rating des Anlageuniversums“ und der Portfoliogewichtung für das „ESG-Rating des Fonds“. Zudem weisen wir darauf hin, dass die Wertentwicklung des Fonds das Rating des investierbaren Anlageuniversums unter Berücksichtigung anderer externer Anbieter von ESG-Ratings übertrifft. Das „investierbare Anlageuniversum“ des Fonds besteht aus 200 Aktien aus dem Infrastrukturbereich, die zusammen als RARE200 bezeichnet werden. Diese werden im Rahmen des Anlageprozesses vierteljährlich überprüft.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
ESG-Rating des Fonds	7,35
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,58

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
ESG-Rating des Fonds	7,35	7,31
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,58	6,45

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	376 657,00	97,18%	319 510,77	92,41%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	430,19	97,18%	313,64	92,41%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 566,37	97,18%	2 125,77	95,98%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	42,85%	95,77%	43,82%	92,41%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,18%	0,00%	95,98%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	95,77%	0,00%	92,41%

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Vor dem Hintergrund des Infrastrukturmandats des Fonds für Investitionen in Schlüsselinfrastrukturwerte und der wichtigen Rolle, die Infrastruktur bei der Bereitstellung grundlegender Dienstleistungen und des Energiewandels spielt, hielt der Fonds Anlagen, die zu den nachhaltigen Zielen im Zusammenhang mit den Zielen Klimaschutz und/oder Anpassung an den Klimawandel beitragen und/oder einen positiven sozialen Beitrag leisteten.

Die wichtigsten Beiträge zu den Zielen seitens nachhaltiger Anlagen umfassten:

- Stromversorgungsunternehmen und Unternehmen für erneuerbare Energien, die den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft und somit die Eindämmung des Klimawandels fördern (39 %)
- Infrastruktur für eine emissionsärmere Mobilität, die den Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft und damit die Eindämmung des Klimawandels fördert (39 %)
- Wasserversorger, welche die Anpassung an den Klimawandel und die sozialen Auswirkungen unterstützen, indem der Zugang zu unentbehrlichem, sauberem und sicherem Wasser gewährleistet wird (15 %)
- Kommunikationsinfrastruktur, mit der eine Transportalternative angeboten werden kann, und deren soziale Wirksamkeit, indem der Zugang zu grundlegenden Diensten gewährleistet wird (7 %)

All dies wurde zunächst anhand der jeweiligen Beiträge zu einem oder beiden der folgenden Punkte bewertet:

- SDG-Ausrichtung von Produkten und Dienstleistungen (49,6 % des Portfolios)
- THG-Intensität und Reduzierungsziele von Emissionen im Rahmen der Wirtschaftsaktivitäten eines Unternehmens, beurteilt von einem Drittanbieter und mit einem verifizierten Dekarbonisierungsziel, das auf das Pariser Abkommen ausgerichtet ist (48 % des Portfolios)

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wichtigen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Bewertung in Bezug auf gute Unternehmensführung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilssektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Für die Integration von ESG in ihren Anlageprozess verwendete die Anlageverwaltung einen Bottom-up-Research-Ansatz, der viele Datenquellen, darunter auch PAI, nutzt. PAI wurden im Kontext des jeweiligen Infrastruktur-Teilssektors berücksichtigt.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI wurden als Bestandteil des allgemeinen ESG-Prozesses und der Berücksichtigung des DNSH-Prinzips (Do No Significant Harm) der Anlageverwaltung betrachtet. Die ESG-Prozesse, bei denen PAI berücksichtigt wurden, umfassten: (i) die eigene ESG-Punktzahl, (ii) Beobachtung von Kontroversen und laufendes Engagement sowie (iii) qualitative ESG-Erwägungen.

Die folgenden PAI wurden einbezogen:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität)

Die Anlageverwaltung bewertete die spezifischen klimabezogenen Risiken und Chancen einzelner Unternehmen im Rahmen ihres Bottom-up Aktienauswahlprozesses, der diese Aspekte neben anderen Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekten mit einbezieht. Jeder Infrastruktur-Teilsektor wurde anhand einer Gewichtung der für seinen Geschäftsbetrieb relevanten Faktoren bewertet. Die Steuerung von THG-Emissionen im Unternehmen einschließlich glaubhafter Reduktionspläne wird auch als Teil dieses Prozesses betrachtet.

PAI Nr. 5 (Anteil der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen)

Die Anlageverwaltung bewertete den Energieerzeugungsmix im Rahmen ihrer Bottom-up-Research-Ansatzes, vor allem da sie ein Bestandteil der Ziele Klimawandel und Netto-Null ist. In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Er wird von spezifischen EU-Kriterien begleitet. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investiert/e nicht in Unternehmen, die Umsätze aus (a) ausgeschlossenen Waffen generieren, gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) dem Übereinkommen über das Verbot von Streumunition und (b) Waffen, die als B- oder C-Waffen gemäß dem Biowaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen bzw. dem Chemiewaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen eingestuft sind.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	376 657,11	97,18%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	430,19	97,18%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 566,37	97,18%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	42,85%	95,77%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,18%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	95,77%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
PG&E CORPORATION	Versorgungsunternehmen	5,00%	USA
CSX Corporation	Industrie	4,44%	USA
GETLINK S.E.	Industrie	4,41%	Frankreich
NEXTERA ENERGY, INC.	Versorgungsunternehmen	4,19%	USA
AMERICAN TOWER CORPORATION	Immobilien	4,11%	USA
SEVERN TRENT PLC	Versorgungsunternehmen	4,07%	Vereinigtes Königreich
EDP - Energias de Portugal, S.A.	Versorgungsunternehmen	3,40%	Portugal
ENTERGY CORPORATION	Versorgungsunternehmen	3,33%	USA
Ferrovial SE	Industrie	3,29%	Spanien
TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE SOCIETA PER AZIONI	Versorgungsunternehmen	3,15%	Italien
ENEL - SPA	Versorgungsunternehmen	3,05%	Italien
UNITED UTILITIES GROUP PLC	Versorgungsunternehmen	2,88%	Vereinigtes Königreich
TRANSURBAN GROUP	Industrie	2,83%	Australien
UNION PACIFIC CORPORATION	Industrie	2,80%	USA
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INCORPORATED	Versorgungsunternehmen	2,66%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

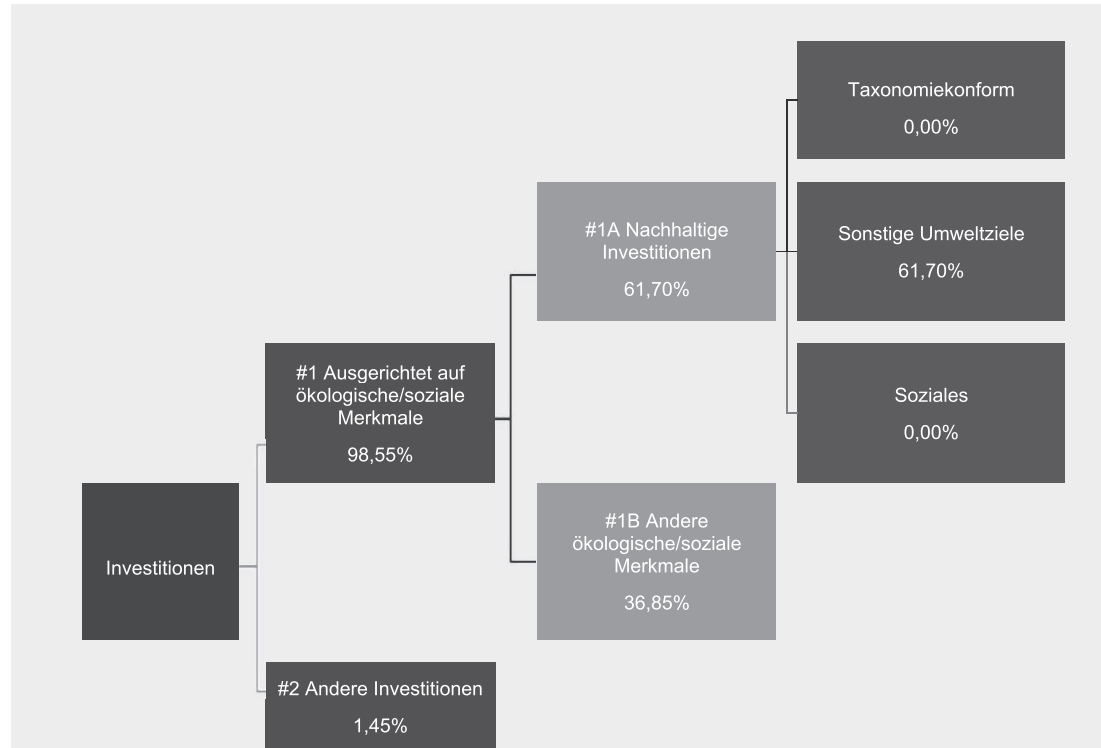
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 61,7 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 98,55 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,45 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 61,7 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Versorgungsunternehmen	51,35%
Industrie	32,04%
Energie	7,46%
Immobilien	4,70%
Kommunikationsdienste	1,63%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Stromversorger	35,59%
Überlandtransport	14,77%
Verkehrsinfrastruktur	12,99%
Wasserversorger	8,36%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	7,46%
Multi-Versorger	7,40%
Spezialisierte REITs	4,70%
Bau- u. Ingenieurwesen	4,29%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,63%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

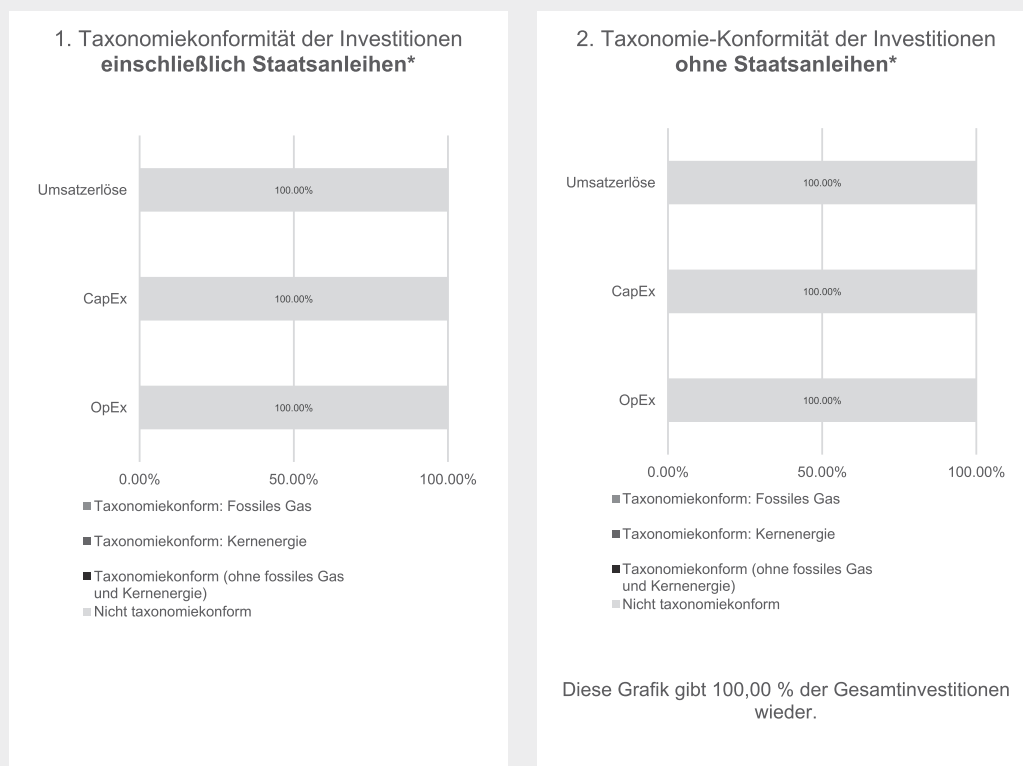
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Investitionen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 61,7 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0,00 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,45 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung wendete den ESG-Prozess einheitlich an. Er wird in alle Schlüsselemente des Anlageprozesses einbezogen und berücksichtigt.

Dies umfasste:

- Negative Screenings bei der Konstruktion des investierbaren Anlageuniversums, um Grenzen bei der Förderung und der Produktion fossiler Brennstoffe, von Tabak, Waffen und UNGC-Verstößen zu beachten
- Anwendung ihres Drei-Säulen-Prozesses der ESG-Integration, nämlich:
 - Prognostizierte Cashflow-Anpassungen auf der Grundlage von ESG-Faktoren
 - Erforderliche Renditeanpassung auf der Basis des ESG-Risikos, wie anhand der eigenen Scorecard des Anlageverwalters beurteilt (siehe unten)
 - Engagement, darunter die Beobachtung von Kontroversen
- Andere ESG-Analysen und -Prozesse, darunter unter anderem Nachhaltigkeitsprüfungen der ESG-Scorecards von Unternehmen, die Analyse des Energiemixes und der Dekarbonisierungspläne, PAI-Überlegungen und so weiter.

Einige der oben genannten Tätigkeiten werden unten mit den jeweiligen Ergebnissen näher beschrieben.

2. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet werden. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:

- AAA: 22 %
- AA: 65 %
- A: 11 %
- B: 0 %

3. Die Anlageverwaltung stand mit ihren Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Die Einzelheiten zum Engagement des Fonds zur Berichterstattung waren wie folgt:

- Umwelt: 31 %
- Soziales: 24 %
- Governance: 44 %

4. Im Ergebnis beachtete der Fonds die bindenden Elemente seiner Anlagestrategie.

5. Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (der „Fonds“)



Unternehmenskennung (LEI-Code):
54930016JDVIT9OWQK33

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 50,10% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte eine positive Wirkung im Hinblick auf:

- Klimaschutz,
- Anpassung an den Klimawandel und/oder
- gesellschaftliche Auswirkungen.

Die Unterstützung positiver Wirkungen in den oben genannten Bereichen führte dazu, dass der Fonds die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Referenzzeitraum förderte:

- Investitionen, die den Übergang zu einer CO2-armen Wirtschaft unterstützen, entweder durch direkte Reduzierung von Emissionen, Ermöglichung von Alternativen mit weniger Emissionen oder Bereitstellung von Ersatzprodukten mit geringeren Emissionen, oder durch Dienstleistungen für den Transport auf der Schiene statt Alternativen per Flugzeug oder auf der Straße,
- Investitionen in Infrastrukturunternehmen, die die Anpassung an den Klimawandel unterstützen,
- Infrastruktur, die gesellschaftliche Auswirkungen unterstützt, wie die Bereitstellung eines gerechten Zugangs zu grundlegenden Dienstleistungen wie Zugang zu Wasser, Energie und Kommunikation, und
- Einhaltung der Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC).

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren umfasst ein ESG-Ratingsystem, das eine Wesentlichkeitskarte benutzt, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen.

Die Anlageverwaltung wendet ihren ESG-Prozess auf alle Anlagen im Berichtszeitraum an. Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 15 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- der Anteil der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der eigenen Methodik für nachhaltige Investitionen der Anlageverwaltung definiert sind (in diesem Fall betrug der Anteil 50,1 %) und
- das ESG-Rating des Fonds (7,82) im Vergleich zum ESG-Rating des Anlageuniversums (6,67), wie in der Tabelle unten ersichtlich.

Dort, wo die ESG-Punktzahlen auf MSCI-Daten beruhen, sind sie gleichgewichtet mit dem „ESG-Rating des Anlageuniversums“ und der Portfoliogewichtung für das „ESG-Rating des Fonds“. Zudem weisen wir darauf hin, dass die Wertentwicklung des Fonds das Rating des investierbaren Anlageuniversums bei Berücksichtigung anderer externer Anbieter von ESG-Ratings übertrifft.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
ESG-Rating des Fonds	7,82
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,67

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
ESG-Rating des Fonds	7,82	7,89
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,67	6,58

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	157 591,00	96,86%	139 114,60	96,67%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	444,57	96,86%	351,77	96,67%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 803,46	96,86%	2 500,32	98,02%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	54,13%	95,18%	61,11%	94,59%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,86%	0,00%	98,02%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	95,18%	0,00%	94,59%

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Vor dem Hintergrund des Infrastrukturmandats des Fonds zur Investition in Schlüsselinfrastrukturwerte und der wichtigen Rolle, die Infrastruktur bei der Bereitstellung grundlegender Dienstleistungen und des Energiewandels spielt, hielt der Fonds Anlagen, die zu den nachhaltigen Zielen im Zusammenhang mit den Zielen Klimaschutz und/oder Anpassung an den Klimawandel beitragen und/oder einen positiven sozialen Beitrag leisteten.

Die wichtigsten Beiträge zu den Zielen seitens nachhaltiger Anlagen umfassen:

- Stromversorgungsunternehmen und Unternehmen für erneuerbarer Energien, die den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft und somit die Eindämmung des Klimawandels fördern (60 %)
- Infrastruktur für eine emissionsärmere Mobilität, die den Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft und damit die Eindämmung des Klimawandels fördert (17 %)
- Wasserversorger, welche die Anpassung an den Klimawandel und die sozialen Auswirkungen unterstützen, indem sie den Zugang zu unentbehrlichem, sauberem und sicherem Wasser gewährleisten (14 %)
- Kommunikationsinfrastrukturunternehmen, die eine Transportalternative anbieten sowie gesellschaftliche Auswirkungen unterstützen, indem sie den Zugang zu grundlegenden Diensten gewährleisten (9 %)

All dies wurde zunächst anhand der jeweiligen Beiträge zu einem oder beiden der folgenden Punkte bewertet:

- SDG-Ausrichtung von Produkten und Dienstleistungen (32,3 % des Portfolios)
- THG-Intensität und Reduzierungsziele von Emissionen im Rahmen der Wirtschaftsaktivitäten eines Unternehmens, beurteilt von einem Drittanbieter und mit einem verifizierten Dekarbonisierungsziel, das auf das Pariser Abkommen ausgerichtet ist (38,8 % des Portfolios)

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wichtigen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Bewertung in Bezug auf gute Unternehmensführung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Für die Integration von ESG in ihren Anlageprozess verwendete die Anlageverwaltung einen Bottom-up-Research-Ansatz, der viele Datenquellen, darunter auch PAI, nutzt. PAI wurden im Kontext des jeweiligen Infrastruktur-Teilsektors berücksichtigt.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI wurden als Bestandteil des allgemeinen ESG-Prozesses und der Berücksichtigung des DNSH-Prinzips (Do No Significant Harm) der Anlageverwaltung betrachtet. Die ESG-Prozesse, bei denen PAI berücksichtigt wurden, umfassten: (i) die eigene ESG-Punktzahl, (ii) Beobachtung von Kontroversen und laufendes Engagement sowie (iii) qualitative ESG-Erwägungen.

Die folgenden PAI wurden einbezogen:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität)

Die Anlageverwaltung bewertete die spezifischen klimabezogenen Risiken und Chancen einzelner Unternehmen im Rahmen ihres Bottom-up Aktienauswahlprozesses, der diese Aspekte neben anderen Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekten mit einbezieht. Jeder Infrastruktur-Teilsektor wurde anhand einer Gewichtung der für seinen Geschäftsbetrieb relevanten Faktoren bewertet. Die Steuerung der THG-Emissionen im Unternehmen einschließlich glaubhafter Reduktionspläne wurde auch als Teil dieses Prozesses betrachtet.

PAI Nr. 5 (Anteil der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen)

Die Anlageverwaltung bewertete den Energieerzeugungsmix im Rahmen ihrer Bottom-up-Research-Ansatzes, vor allem da sie ein Bestandteil der Ziele Klimawandel und Netto-Null ist.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investiert/e nicht in Unternehmen, die Umsätze aus (a) ausgeschlossenen Waffen generieren, gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) dem Übereinkommen über das Verbot von Streumunition und (b) Waffen, die als B- oder C-Waffen gemäß dem Biowaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen bzw. dem Chemiewaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen eingestuft sind.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	157 591,00	96,86%
CO2-Bilanz (USD)	tCO2e/investierte Mio. \$	444,57	96,86%
THG-Intensität (USD)	tCO2e/Mio. \$ Umsatz	1 803,46	96,86%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	54,13%	95,18%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,86%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	95,18%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
EDP - Energias de Portugal, S.A.	Versorgungsunternehmen	4,76%	Portugal
NATIONAL GRID PLC	Versorgungsunternehmen	4,54%	Vereinigtes Königreich
THE SOUTHERN COMPANY	Versorgungsunternehmen	4,03%	USA
ENTERGY CORPORATION	Versorgungsunternehmen	3,91%	USA
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INCORPORATED	Versorgungsunternehmen	3,51%	USA
AMERICAN TOWER CORPORATION	Immobilien	3,47%	USA
SNAM S.P.A.	Versorgungsunternehmen	3,45%	Italien
OGE ENERGY CORP.	Versorgungsunternehmen	3,40%	USA
West Japan Railway Company	Industrie	3,40%	Japan
ENEL - SPA	Versorgungsunternehmen	3,24%	Italien
CROWN CASTLE INC.	Immobilien	3,18%	USA
NEXTERA ENERGY, INC.	Versorgungsunternehmen	3,08%	USA
UNION PACIFIC CORPORATION	Industrie	3,00%	USA
PEMBINA PIPELINE CORPORATION	Energie	2,85%	Kanada
EDISON INTERNATIONAL	Versorgungsunternehmen	2,61%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

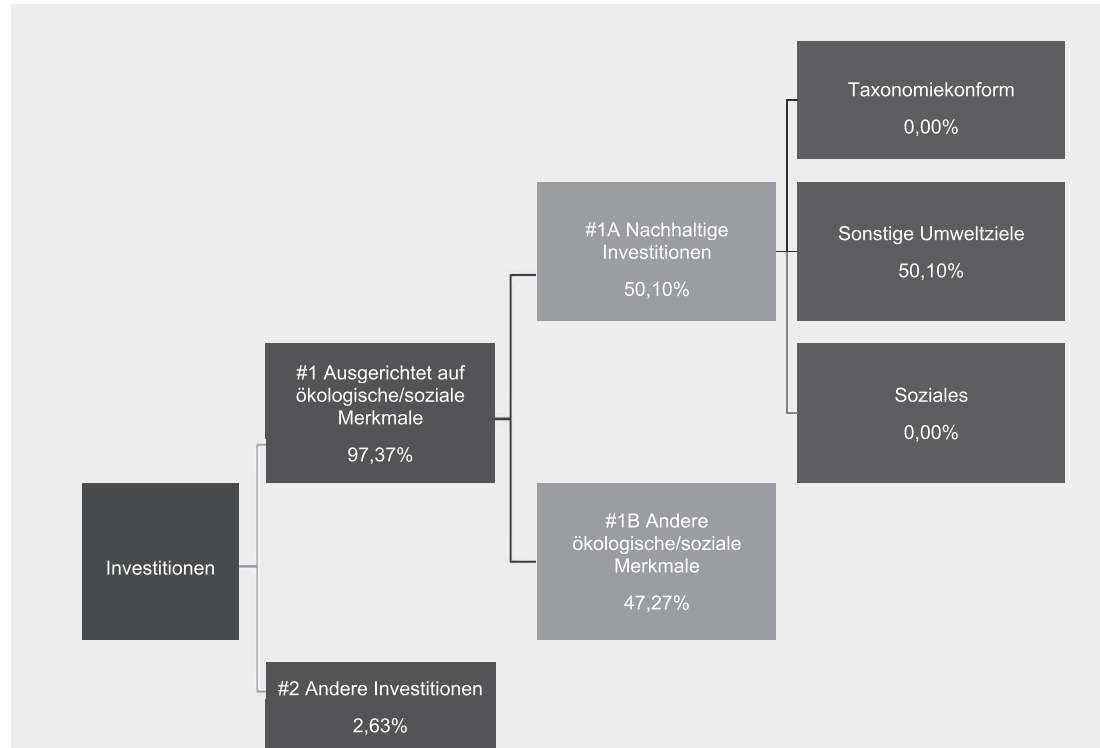
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 50,1 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 97,37 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,63 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 50,1 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Versorgungsunternehmen	66,41%
Industrie	15,74%
Energie	8,06%
Immobilien	6,64%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Stromversorger	37,60%
Gasversorger	10,36%
Multi-Versorger	10,04%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	8,06%
Verkehrsinfrastruktur	6,75%
Spezialisierte REITs	6,64%
Überlandtransport	6,40%
Wasserversorger	4,67%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	3,73%
Bau- u. Ingenieurwesen	2,59%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

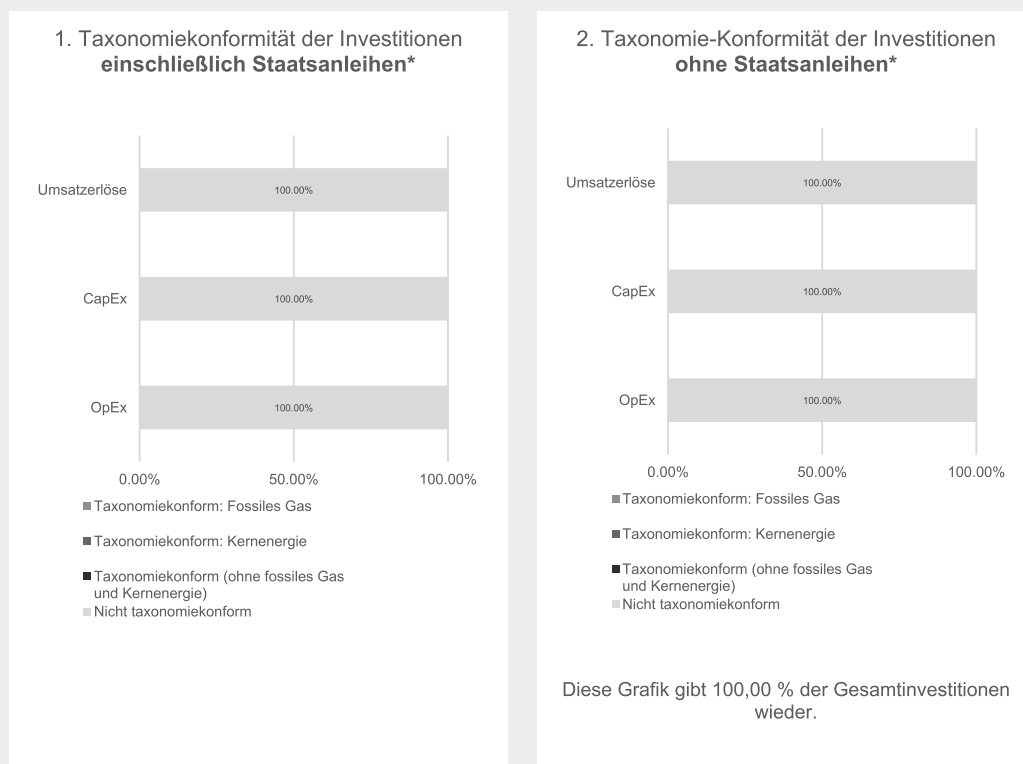
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Investitionen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 50,1 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0,0 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 2,63 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung wendete den ESG-Prozess einheitlich an. Er wird in alle Schlüsselemente des Anlageprozesses einbezogen und berücksichtigt.

Dies umfasste:

- Negative Screenings bei der Konstruktion des investierbaren Anlageuniversums, um Grenzen bei der Förderung und der Produktion fossiler Brennstoffe, von Tabak, Waffen und UNGC-Verstößen zu beachten
- Anwendung ihres Drei-Säulen-Prozesses der ESG-Integration, nämlich:
 - Prognostizierte Cashflow-Anpassungen auf der Grundlage von ESG-Faktoren
 - Erforderliche Renditeanpassung auf der Basis des ESG-Risikos, wie anhand der eigenen Scorecard des Anlageverwalters beurteilt (siehe unten)
 - Engagement, darunter die Beobachtung von Kontroversen
- Andere ESG-Analysen und -Prozesse, darunter unter anderem Nachhaltigkeitsprüfungen der ESG-Scorecards von Unternehmen, die Analyse des Energiemixes und der Dekarbonisierungspläne, PAI-Überlegungen und so weiter.

Einige der oben genannten Tätigkeiten werden unten mit den jeweiligen Ergebnissen näher beschrieben.

2. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet werden. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:

- AAA: 19 %
- AA: 71 %
- A: 6 %
- B: 0 %

3. Die Anlageverwaltung stand mit ihren Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement der Anlageverwaltung hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Die Einzelheiten zum Engagement des Fonds im Referenzzeitraum waren wie folgt:

- Umwelt: 33 %
- Soziales: 25 %
- Governance: 42 %

4. Im Ergebnis beachtete der Fonds die bindenden Elemente seiner Anlagestrategie.

5. Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund (der „Fonds“)



Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900JA2MNQ8SPZ8938

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 46,80% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte während des Berichtszeitraums eine Reihe von ökologischen und sozialen Merkmalen, die der Anlageverwalter für das jeweilige Unternehmen und die Branche, in der das Unternehmen tätig ist, als wesentlich erachtete. Diese Merkmale umfassten unter anderem:

Umwelt:

- Klimaschutz
- Anpassung an den Klimawandel
- Wasser
- Artenvielfalt

Soziales:

- Gesundheit u. Sicherheit
- Geschlechtervielfalt
- Finanzielle Integration
- Ernährungssicherheit
- Sauberes Wasser

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 10 % an „nachhaltigen Investitionen“ ein.

Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Der Anteil (46,8 %) der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der eigenen Methodik für nachhaltige Investitionen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („SDG“). Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Spezifische Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal adverse impact, „PAI“), nämlich PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind), PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

- Portfoliobeteiligung an Unternehmen, die sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt haben (54,2 %)
- Firmeneigene Methoden, um die Fortschritte der ESG-Engagement-Meetings des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 30,2 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in all ihren Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder Unternehmen, die Klimalösungen anbieten. Die Ermittelten werden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 40,5 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

-----Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

-----Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen,

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.
Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings des Anlageverwalters berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Intensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Umfeld, die geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren. Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten.

Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung kann auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durchführen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretninen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Reichweite 3 USD	tCO ₂ e	5 447,99	91,65%
CO ₂ -Bilanz (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. \$	1 167,84	91,65%
THG-Intensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. \$ Umsatz	1 276,97	91,65%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (USD)	GWh pro Mio. \$ Absatz	2,90	76,77%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	91,65%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	37,73%	91,65%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	91,65%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Hitachi, Ltd.	Industrie	4,98%	Japan
TotalEnergies SE	Energie	4,55%	Frankreich
COMPASS GROUP PLC	Zyklische Konsumgüter	4,17%	Vereinigtes Königreich
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A.	Finanzsektor	3,90%	Spanien
META PLATFORMS, INC.	Kommunikationsdienste	3,66%	USA
WELLS FARGO & COMPANY	Finanzsektor	3,60%	USA
FISERV, INC.	Finanzsektor	3,53%	USA
VERTIV HOLDINGS CO	Industrie	3,38%	USA
ORACLE CORPORATION	Informationstechnologie	3,37%	USA
ASTRAZENECA PLC	Gesundheitssektor	3,31%	Vereinigtes Königreich
UNILEVER PLC	Basiskonsumgüter	3,25%	Vereinigtes Königreich
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP, INC.	Finanzsektor	3,20%	USA
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitssektor	3,16%	USA
Siemens Aktiengesellschaft	Industrie	2,93%	Deutschland
BNP PARIBAS SA	Finanzsektor	2,87%	Frankreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

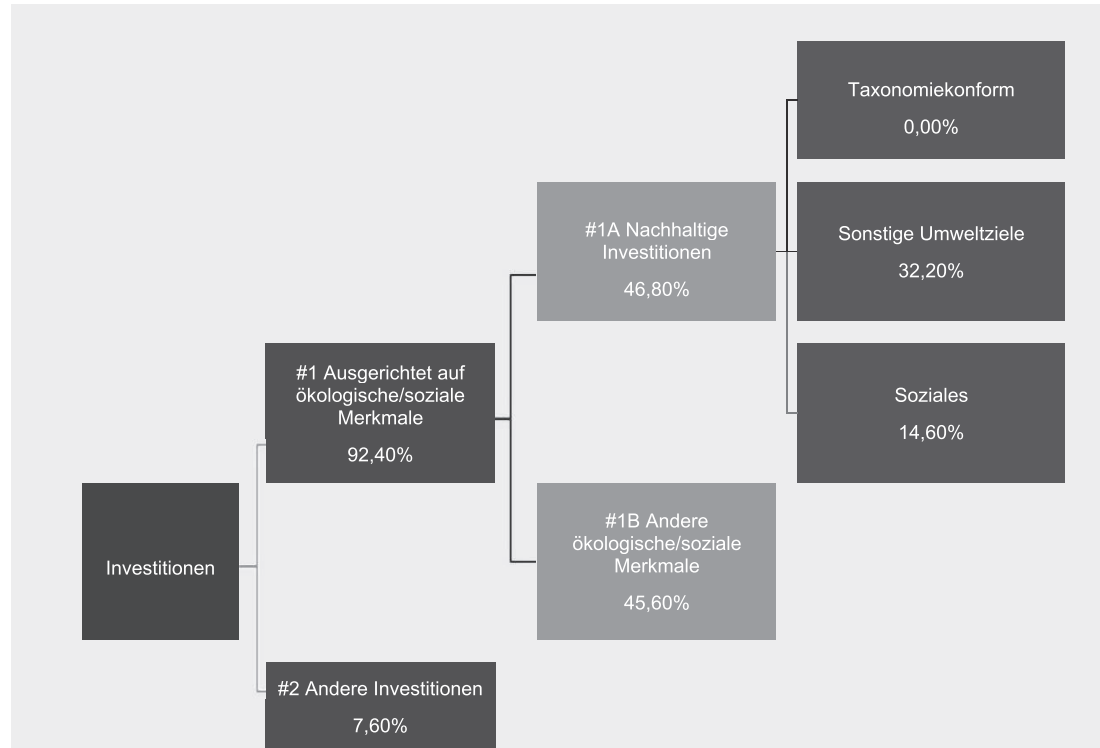
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 46,8 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 92,4 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (7,6 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 46,8 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	22,84%
Industrie	21,03%
Gesundheitssektor	11,54%
Versorgungsunternehmen	8,29%
Energie	7,38%
Basiskonsumgüter	5,66%
Zyklische Konsumgüter	4,17%
Grundstoffe	3,69%
Kommunikationsdienste	3,66%
Informationstechnologie	3,37%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	12,26%
Elektronikgeräte	9,38%
Industriekonzerne	7,91%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	7,38%
Pharma	6,47%
Produkte für den persönlichen Bedarf	5,66%
Versicherungen	5,15%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	4,17%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	3,66%
Finanzdienstleistungen	3,53%
Software	3,37%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	3,23%
Überlandtransport	2,71%
Metalle u. Bergbau	2,37%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,33%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

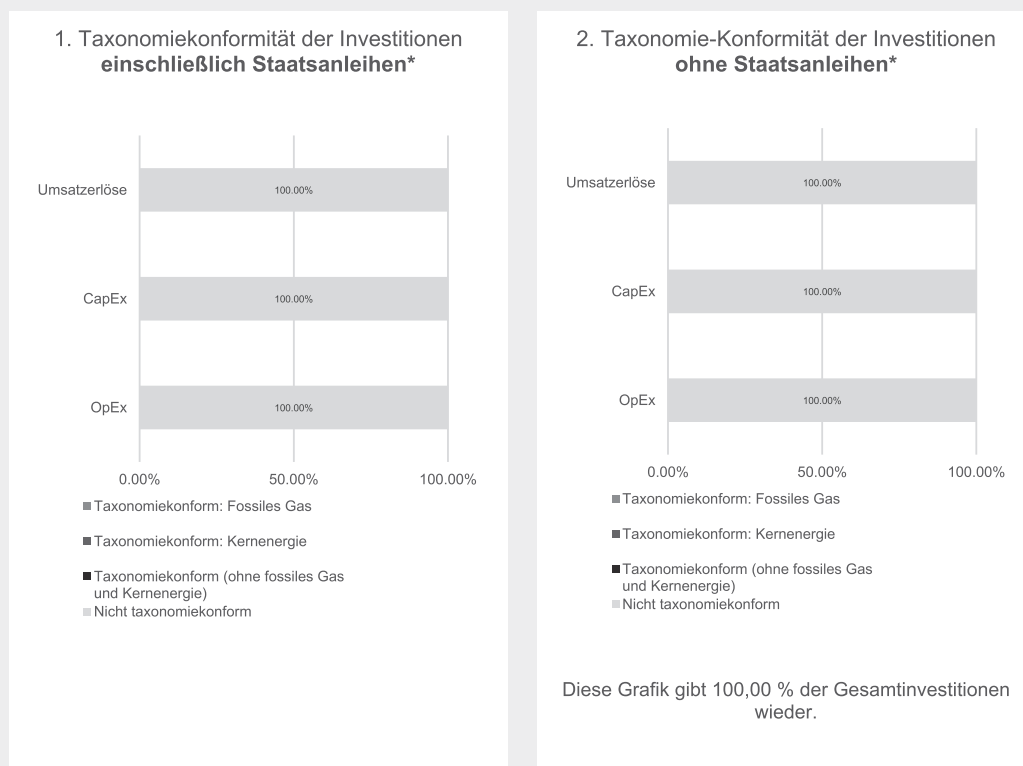
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2024 Investitionen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 32,2 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 14,6 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Investitionen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 7,6 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Konventionelle und umstrittene Waffen
- Tabak
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

2. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 29.2.2024 wie folgt aus:

AAA: 16 %

AA: 45 %

A: 31 %

B: 0 %

3. Der Anlageverwalter stand mit seinen Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen eines oder mehrere der zehn Prinzipien in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.

5. Die Vermögenswerte des Fonds wurden hinsichtlich einer möglichen Verschlechterung oder Verbesserung von ökologischen und sozialen Faktoren verfolgt und überwacht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund (der „Fonds“)



**FRANKLIN
TEMPLETON**

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493007B7CQP4E08O434

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 83,84% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Um die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen, investierte der Fonds in Unternehmen mit den folgenden Merkmalen:

- die ihren CO₂-Ausstoß reduzieren und kontrollieren,
- mit begrenztem oder gar keinem Engagement in der fossilen Brennstoffindustrie,
- mit einem Schwerpunkt auf der effizienten Nutzung von Energie und Wasser,
- die die Verschmutzung begrenzen und die Risiken für die Artenvielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und
- ohne Engagement in kontroversen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Wie im eigenen Rahmen des Anlageverwalters auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 84 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Berichtszeitraums waren 60 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftlich fundierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 22 % in Unternehmen, die sich dazu verpflichtet haben, sich innerhalb der kommenden zwei Jahre entsprechende Ziele zu setzen.

Im Laufe des Berichtszeitraums intervenierte das Fondsmanagement-Team siebenmal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung des Vorstands und die

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Vergütung von Verwaltungsratsmitgliedern abgedeckt. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO2-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO2-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

Im Rahmen unserer Richtlinie für Klima-Engagement und Eskalation haben wir Unternehmen anhand unserer internen Kategorisierung für die Ausrichtung an Netto-Null-Zielen in verschiedene Gruppen eingestuft. Dadurch können sich unsere Kunden noch umfassender informieren. Darüber hinaus haben sie Zugang zu Informationen über Vermögenswerte, die an spezifische Ziele gebunden sind, welche auf der Grundlage der Annahme wissenschaftlich fundierter Ziele festgelegt wurden. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Engagements: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	0,00%
Engagements: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	14,00%
Engagements: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	71,00%
Engagements: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	14,00%
Engagements: 5. Unternehmen greift das Thema auf	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	59,70%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	22,10%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	9,60%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	8,60%

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Der Anteil des in Unternehmen mit wissenschaftlich fundierten Zielen investierten Nettoinventarwerts des Fonds (60 % am Ende des letzten Berichtszeitraums) hat sich im Vergleich zum vorangegangenen Berichtszeitraum nicht verändert, während der Anteil der Unternehmen, die sich zur Festlegung wissenschaftlich fundierter Ziele verpflichtet haben, von 7 % auf 22 % gestiegen ist.

Im Vergleich zum Vorquartal wurde der Austausch zu ESG-Themen mit dem Ziel der Einflussnahme auf das Verhalten der Unternehmen intensiviert. Die Zahl der Interventionen stieg von 5 auf 7. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert
Engagements: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	0,00%	40,00%
Engagements: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	14,00%	0,00%
Engagements: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	71,00%	0,00%
Engagements: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	14,00%	40,00%
Engagements: 5. Unternehmen greift das Thema auf	0,00%	20,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	59,70%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	22,10%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	9,60%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	8,60%	N/A

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	8 886,22	99,38%	8 716,25	99,49%
CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	65,92	99,38%	67,27	99,49%
THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	358,02	99,38%	431,12	99,49%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	57,73%	83,94%	65,03%	85,02%
Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs : Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,31	92,25%	0,34	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs : Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs : Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs : Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,02	92,25%	0,02	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%	1,01	10,62%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,05	43,01%	0,06	36,29%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	43,22%	99,38%	52,33%	99,12%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	12,16%	37,97%	11,75%	20,44%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	35,84%	99,38%	32,86%	99,49%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten Aktien von Unternehmen, die durch ihre Produkte oder Dienstleistungen zu den ökologischen oder sozialen Zielen einer relevanten Untergruppe der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDG) beitrugen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO2-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen haben. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigte. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und

- Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	8 886,22	99,38%
CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	65,92	99,38%
THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	358,02	99,38%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,38%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	57,73%	83,94%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,31	92,25%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,02	92,25%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	92,25%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,38%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,05	43,01%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,38%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	43,22%	99,38%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	12,16%	37,97%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	35,84%	99,38%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,38%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
NVIDIA CORPORATION	Informationstechnologie	9,10%	USA
ASML Holding N.V.	Informationstechnologie	5,83%	Niederlande
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	5,79%	USA
LINDE PUBLIC LIMITED COMPANY	Grundstoffe	4,90%	Vereinigtes Königreich
Ferrari N.V.	Zyklische Konsumgüter	4,53%	Italien
MONCLER S.P.A.	Zyklische Konsumgüter	4,14%	Italien
L'OREAL SA	Basiskonsumgüter	4,05%	Frankreich
Atlas Copco Aktiebolag	Industrie	3,99%	Schweden
MASTERCARD INCORPORATED.	Finanzsektor	3,74%	USA
KINGSPAN GROUP PUBLIC LIMITED COMPANY	Industrie	3,72%	Irland
COLOPLAST A/S	Gesundheitssektor	3,05%	Dänemark
CSL LIMITED	Gesundheitssektor	2,98%	Australien
Adyen N.V.	Finanzsektor	2,93%	Niederlande
RESMED INC.	Gesundheitssektor	2,80%	USA
ZOETIS INC.	Gesundheitssektor	2,70%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

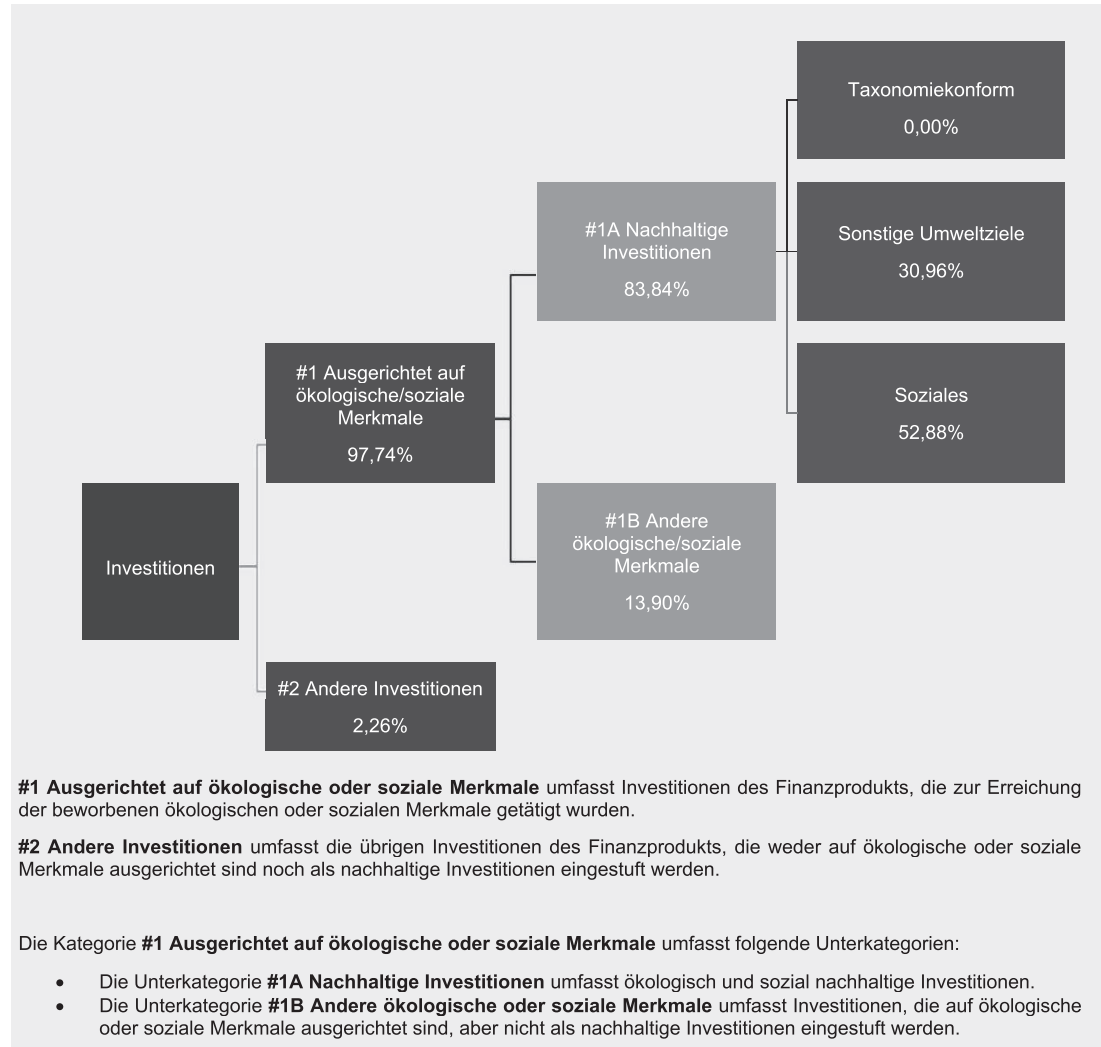
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 83,84 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,74 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,26 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 83,84 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	30,77%
Gesundheitssektor	22,55%
Zyklische Konsumgüter	12,93%
Industrie	10,18%
Basiskonsumgüter	8,48%
Finanzsektor	7,29%
Grundstoffe	7,20%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	14,93%
Software	13,39%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	8,40%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	7,98%
Chemische Erzeugnisse	7,20%
Finanzdienstleistungen	6,67%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	6,58%
Baustoffe	6,18%
Produkte für den persönlichen Bedarf	5,62%
Automobilindustrie	4,53%
Maschinen	3,99%
Biotechnologie	2,98%
Pharma	2,70%
Elektronische Ausrüstung, Geräte u. Komponenten	2,45%
Getränke	2,36%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

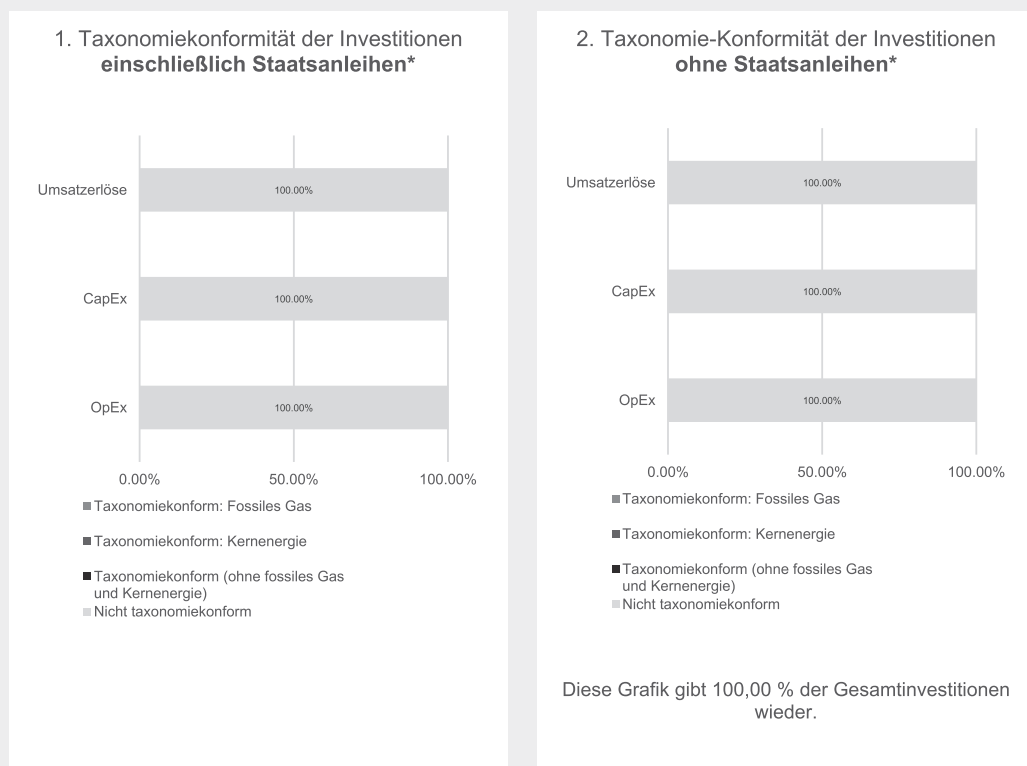
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 30,96 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 52,88 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 2,26 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

- Es fand ein Austausch mit den Portfoliounternehmen über die Initiativen zur Reduzierung der Treibhausgasemissionen statt.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf eigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und alle anderen ausgeschlossene Geschäftsaktivitäten.
- Berücksichtigung aller 14 verbindlichen PAI und von zwei zusätzlichen PAI als Teil der Investmentanalyse, die Indikatoren zur Energie- und Wassereffizienz, Umweltverschmutzung und Risiken für die biologische Vielfalt umfassen.
- Unternehmen, die ein Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher haben, wurden nicht in den Fonds aufgenommen. Die Ratingskala reicht von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko).



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund (der „Fonds“)



Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300REHT50ARB1IW32

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> JA	●● <input checked="" type="checkbox"/> NEIN
<input type="checkbox"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 0,00%	<input checked="" type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben , und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 74,90% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Um die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen, investierte der Fonds in Unternehmen mit den folgenden Merkmalen:

- die ihren CO₂-Ausstoß reduzieren und kontrollieren,
- mit begrenztem oder gar keinem Engagement in der fossilen Brennstoffindustrie,
- mit einem Schwerpunkt auf der effizienten Nutzung von Energie und Wasser,
- die die Verschmutzung begrenzen und die Risiken für die Artenvielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und
- ohne Engagement in kontroversen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Wie im eigenen Rahmen des Anlageverwalters auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 81 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Berichtszeitraums waren 16 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftlich fundierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 11 % in Unternehmen, die sich dazu verpflichtet haben, sich innerhalb der kommenden zwei Jahre entsprechende Ziele zu setzen.

Im Laufe des Berichtszeitraums intervenierte das Management-Team viermal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie Vergütung und Anreize für das Management sowie

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Möglichkeiten des Umstiegs auf kohlenstoffarme Technologien abgedeckt. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO2-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO2-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

Im Rahmen unserer Richtlinie für Klima-Engagement und Eskalation haben wir Unternehmen anhand unserer internen Kategorisierung für die Ausrichtung an Netto-Null-Zielen in verschiedene Gruppen eingestuft. Dadurch können sich unsere Kunden noch umfassender informieren. Darüber hinaus haben sie Zugang zu Informationen über Vermögenswerte, die an spezifische Ziele gebunden sind, welche auf der Grundlage der Annahme wissenschaftlich fundierter Ziele festgelegt wurden. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Engagements: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	75,00%
Engagements: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	0,00%
Engagements: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	25,00%
Engagements: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	0,00%
Engagements: 5. Unternehmen greift das Thema auf	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	20,80%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	11,40%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	9,90%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	57,90%

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Der Anteil des in Unternehmen mit wissenschaftlich fundierten Zielen investierten Nettoinventarwerts des Fonds ist im Vergleich zum vorangegangenen Berichtszeitraum von 12 % am Ende des vorherigen Zeitraums auf nun 16 % gestiegen, während der Anteil der Unternehmen, die sich zur Festlegung wissenschaftlich fundierter Ziele verpflichtet haben, von 16 % auf 11 % gesunken ist. Dies liegt teilweise daran, dass Unternehmen, die sich zuvor zur Festlegung von Zielvorgaben verpflichtet hatten, nun diesen Schritt vollziehen und ihre Verpflichtungen konkretisieren.

Bei den Interventionen ist die Zahl der Interventionen zu ESG-Themen mit dem Ziel der Einflussnahme auf das Verhalten von 8 auf 4 gesunken. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
Wert	Wert	Wert
Engagements: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	75,00%	N/A
Engagements: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	0,00%	N/A
Engagements: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	25,00%	N/A
Engagements: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	0,00%	N/A
Engagements: 5. Unternehmen greift das Thema auf	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	20,80%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	11,40%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	9,90%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	57,90%	N/A

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	14 029,70	96,38%	19 032,27	88,06%
CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	666,45	96,38%	854,37	88,06%
THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	1 103,09	94,62%	1 411,15	88,06%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	16,05%	92,50%	15,95%	88,06%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	79,49%	64,73%	81,00%	80,36%
Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	80,07%	0,00	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	3,64	80,07%	0,01	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs : Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	80,07%	0,00	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs : Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	13,25	80,07%	8,92	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs : Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	4,27	80,07%	4,70	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs : Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,10	80,07%	0,05	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	80,07%	0,00	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,49	80,07%	1,06	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,36	80,07%	0,24	86,78%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,50%	0,00%	88,06%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,02	1,33%	0,00	0,00%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,19	37,88%	0,34	28,29%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,38%	0,00%	95,90%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	65,18%	92,50%	56,51%	84,70%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	9,84%	2,80%	17,86%	2,48%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	28,83%	92,50%	28,83%	88,06%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,50%	0,00%	88,06%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten Aktien von Unternehmen, die durch ihre Produkte oder Dienstleistungen zu den ökologischen oder sozialen Zielen einer relevanten Untergruppe der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDG) beitrugen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO2-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigte. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und

- Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	14 029,70	96,38%
CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	666,45	96,38%
THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	1 103,09	94,62%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	16,05%	92,50%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	79,49%	64,73%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	80,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	3,64	80,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	80,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	13,25	80,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	4,27	80,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,10	80,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	80,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,49	80,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,36	80,07%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,50%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,02	1,33%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,19	37,88%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,38%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	65,18%	92,50%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	9,84%	2,80%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	28,83%	92,50%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,50%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
AURIZON HOLDINGS LIMITED	Industrie	6,53%	Australien
Link Real Estate Investment Trust	Immobilien	5,89%	Hongkong
SCENTRE GROUP	Immobilien	5,49%	Australien
Embassy Office Parks REIT	Immobilien	5,29%	Indien
GUANGDONG INVESTMENT LIMITED	Versorgungsunternehmen	5,07%	Hongkong
CHORUS LIMITED	Kommunikationsdienste	4,38%	Neuseeland
POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	Versorgungsunternehmen	4,34%	Indien
CHARTER HALL RETAIL REIT	Immobilien	4,11%	Australien
CLP HOLDINGS LIMITED	Versorgungsunternehmen	3,69%	Hongkong
Fortune Real Estate Investment Trust	Immobilien	3,28%	Hongkong
Vicinity Centres	Immobilien	3,17%	Australien
AGL ENERGY LIMITED	Versorgungsunternehmen	3,17%	Australien
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED	Finanzsektor	2,93%	Thailand
CapitaLand India Trust	Immobilien	2,80%	Singapur
Yuexiu Transport infrastructure Limited	Industrie	2,78%	Hongkong



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

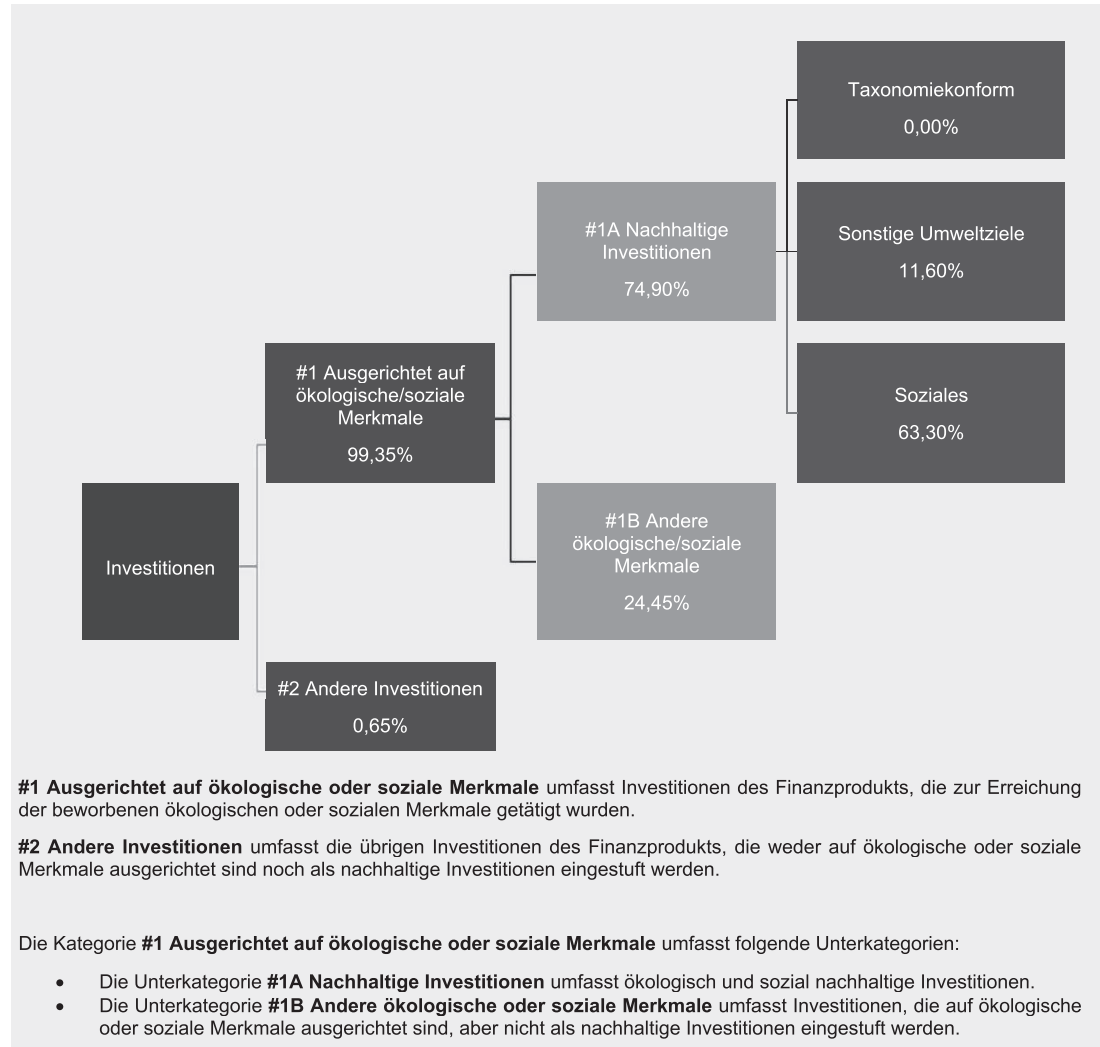
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 74,90 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,35 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,65 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 74,90 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Immobilien	45,17%
Versorgungsunternehmen	24,07%
Industrie	15,86%
Kommunikationsdienste	9,88%
Finanzsektor	2,93%
Wichtigster Teilssektor	% der Vermögenswerte
REITs – Einzelhandel	27,77%
Stromversorger	11,77%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	9,88%
Verkehrsinfrastruktur	9,33%
Überlandtransport	6,53%
Diversifizierte REITs	5,39%
REITs – Büro	5,29%
Wasserversorger	5,07%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	4,30%
Multi-Versorger	3,17%
Gasversorger	3,02%
Finanzdienstleistungen	2,93%
REITs – Industrie	2,42%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	1,04%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

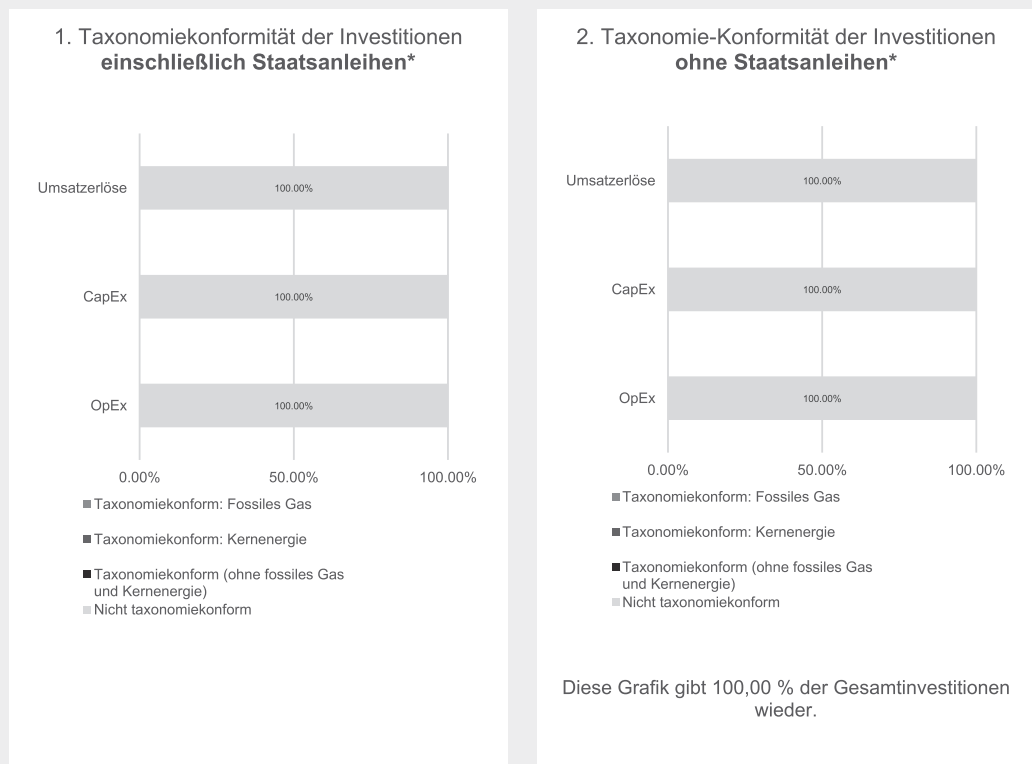
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 11,60 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 63,30 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 0,65 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

- Wir haben mit den Portfoliounternehmen über ihre derzeitige variable Vergütungsstruktur gesprochen, die zu suboptimalen Ergebnissen für die Aktionäre führen könnte, und haben unsere diesbezüglichen Präferenzen dargelegt. Darüber hinaus besprachen die Portfoliomanager die Festlegung klarerer Pläne für die Umstellung auf eine kohlenstoffärmere Technologie sowie sonstige ESG-Themen bei einigen Portfoliounternehmen.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf eigene Ratings zu Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und andere ausgeschlossene Geschäftsaktivitäten.
- Berücksichtigung aller 14 verbindlichen PAI und von zwei zusätzlichen PAI als Teil der Investmentanalyse, die Indikatoren zur Energie- und Wassereffizienz, Umweltverschmutzung und Risiken für die biologische Vielfalt umfassen.
- Unternehmen, die in Bezug auf die Nachhaltigkeit ein Risikoring von 5 haben, wurden nicht in den Fonds aufgenommen. Die Ratingskala reicht von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko).
- Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds. Dabei handelt es sich um Aktien aus Industrie- und/oder Schwellenländern, die im MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index vertreten sind.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund (der „Fonds“)



FRANKLIN
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300Y8TPNIB3NAMF62

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 72,55% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Um die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen, investierte der Fonds in Unternehmen mit den folgenden Merkmalen:

- die ihren CO₂-Ausstoß reduzieren und kontrollieren,
- mit begrenztem oder gar keinem Engagement in der fossilen Brennstoffindustrie,
- mit einem Schwerpunkt auf der effizienten Nutzung von Energie und Wasser,
- die die Verschmutzung begrenzen und die Risiken für die Artenvielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und
- ohne Engagement in kontroversen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Wie im eigenen Rahmen des Anlageverwalters auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 72 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Berichtszeitraums waren 17 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftlich fundierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 11 % in Unternehmen, die sich dazu verpflichtet haben, sich innerhalb der kommenden zwei Jahre entsprechende Ziele zu setzen.

Im Laufe des Berichtszeitraums intervenierte das Management-Team 90 Mal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen abgedeckt, wie die Zusammensetzung des Vorstands, die Pläne

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

der Unternehmen zum Übergang auf Netto-Null sowie die Unternehmenskultur. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO2-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO2-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

Im Rahmen unserer Richtlinie für Klima-Engagement und Eskalation haben wir Unternehmen anhand unserer internen Kategorisierung für die Ausrichtung an Netto-Null-Zielen in verschiedene Gruppen eingestuft. Dadurch können sich unsere Kunden noch umfassender informieren. Darüber hinaus haben sie Zugang zu Informationen über Vermögenswerte, die an spezifische Ziele gebunden sind, welche auf der Grundlage der Annahme wissenschaftlich fundierter Ziele festgelegt wurden. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Engagements: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	23,00%
Engagements: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	11,00%
Engagements: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	53,00%
Engagements: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	9,00%
Engagements: 5. Unternehmen greift das Thema auf	4,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	17,40%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	11,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	14,30%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	57,30%

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Der Anteil des in Unternehmen mit wissenschaftlich fundierten Zielen investierten Nettoinventarwerts des Fonds ist gegenüber dem Stand vom 3.1.2023 von 4 % auf 1 % gesunken, während der Anteil der Unternehmen, die sich zur Festlegung wissenschaftlich fundierter Ziele verpflichtet haben, von 20 % auf 11 % abgenommen hat. Dies liegt vor allem daran, dass Unternehmen, die sich zuvor zur Festlegung von Zielvorgaben verpflichtet hatten, nun diesen Schritt vollziehen und ihre Verpflichtungen konkretisieren.

Die Zahl der Interventionen in der frühen und mittleren Phase hat zugenommen, während die Zahl der Interventionen in der späten Phase zurückgegangen ist. Dies ist darauf zurückzuführen, dass wir kontinuierlich Gespräche mit unseren Portfoliounternehmen über wichtige Fragen führen und einige davon nun erfolgreich zum Abschluss gekommen sind. Die konkreten Werte finden Sie im letzten Jahresbericht.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert
Engagements: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	23,00%	4,00%
Engagements: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	11,00%	12,00%
Engagements: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	53,00%	58,00%
Engagements: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	9,00%	19,00%
Engagements: 5. Unternehmen greift das Thema auf	4,00%	8,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	17,40%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	11,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	14,30%	N/A

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
	Wert	Wert
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	57,30%	N/A

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	11 584,50	97,41%	11 085,00	96,39%
CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	362,44	97,41%	329,97	96,39%
THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	912,40	97,32%	1 004,71	96,39%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	6,87%	97,20%	7,95%	96,39%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	86,53%	75,94%	86,15%	81,90%
Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,43	81,19%	1,47	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs : Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,42	81,19%	3,01	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs : Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,52	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs : Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs : Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,21	81,19%	0,22	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,07	81,19%	0,07	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf	Investierter prozentualer Anteil	0,00%	97,20%	0,00%	96,39%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	des Fondsvermögens				
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	3,34%	0,02	14,67%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	1,07	47,28%	0,45	50,50%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,38%	0,00%	96,68%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	66,13%	97,20%	74,61%	95,98%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	24,15%	8,73%	25,65%	9,73%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	19,98%	97,12%	18,30%	96,39%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,20%	0,00%	96,39%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten Aktien von Unternehmen, die durch ihre Produkte oder Dienstleistungen zu den ökologischen oder sozialen Zielen einer relevanten Untergruppe der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDG) beitrugen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO₂-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigte. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),

- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstegefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	11 584,50	97,41%
CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	362,44	97,41%
THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	912,40	97,32%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	6,87%	97,20%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	86,53%	75,94%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	81,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,43	81,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,42	81,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,52	81,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	81,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	81,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,21	81,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,07	81,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	81,19%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,20%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	3,34%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	1,07	47,28%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,38%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	66,13%	97,20%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	24,15%	8,73%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	19,98%	97,12%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,20%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	Informationstechnologie	9,71%	Taiwan
Samsung Electronics Co., Ltd.	Informationstechnologie	8,73%	Südkorea
Tencent Holdings Limited	Kommunikationsdienste	5,95%	China
SK hynix Inc.	Informationstechnologie	3,79%	Südkorea
HDFC BANK LIMITED	Finanzsektor	3,50%	Indien
ICICI BANK LIMITED	Finanzsektor	3,33%	Indien
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	Zyklische Konsumgüter	3,25%	China
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	Energie	2,95%	Indien
TITAN COMPANY LIMITED	Zyklische Konsumgüter	2,83%	Indien
PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk	Finanzsektor	2,39%	Indonesien
AIA Group Limited	Finanzsektor	2,30%	Hongkong
ANTOFAGASTA PLC	Grundstoffe	2,10%	Vereinigtes Königreich
Grupo Financiero Banorte, S.A.B. de C.V.	Finanzsektor	2,05%	Mexiko
WEG S.A.	Industrie	2,02%	Brasilien
Al Rajhi Banking & Investment Corporation SJSC	Finanzsektor	1,89%	Saudi-Arabien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

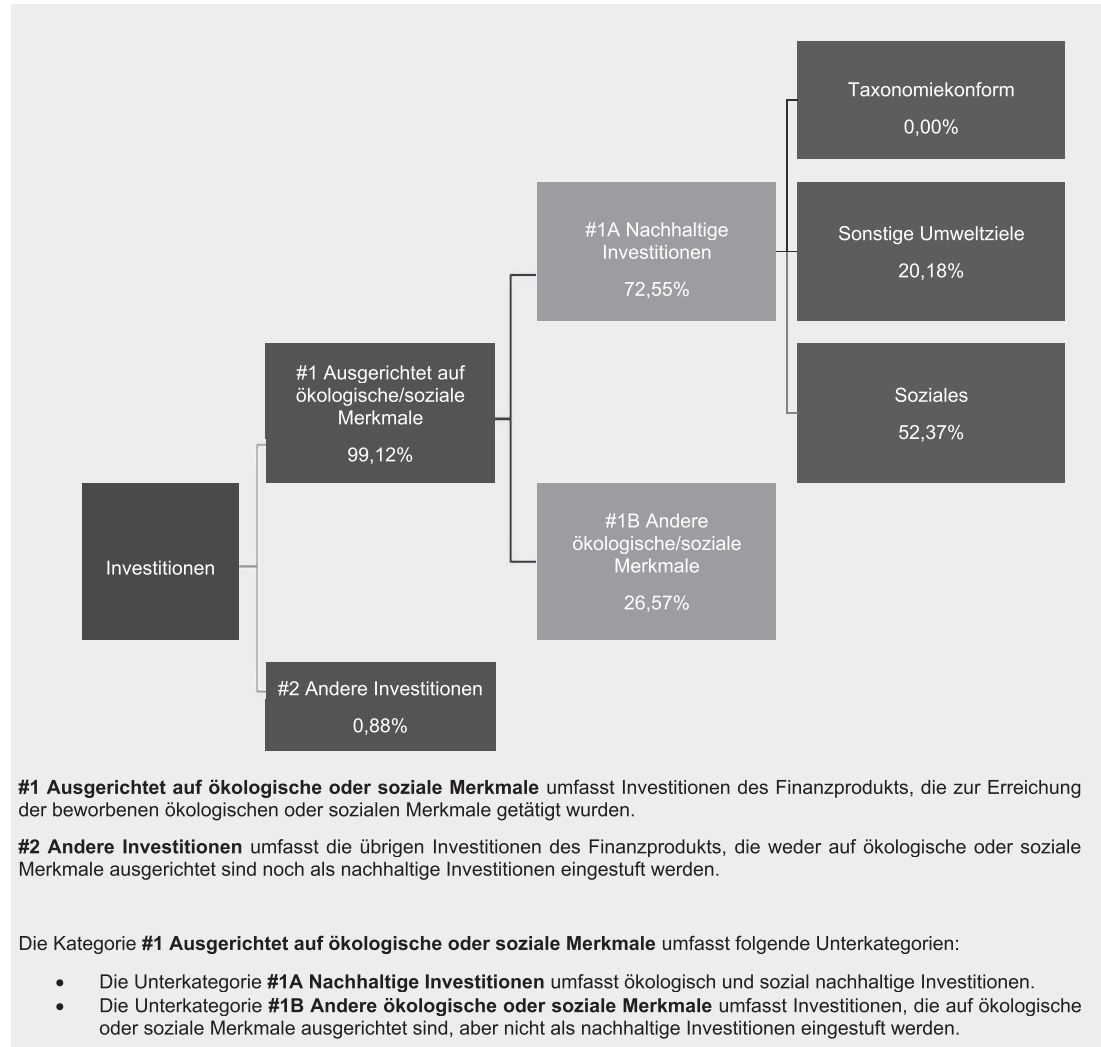
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 72,55 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,12 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,88 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 72,55 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	30,21%
Finanzsektor	25,49%
Zyklische Konsumgüter	11,82%
Kommunikationsdienste	8,11%
Grundstoffe	7,18%
Industrie	5,09%
Energie	4,75%
Gesundheitssektor	3,37%
Basiskonsumgüter	2,61%
Versorgungsunternehmen	0,41%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	19,76%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	15,71%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	8,73%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	6,83%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	4,75%
Allgemeiner Einzelhandel	4,63%
Versicherungen	4,15%
Elektronikgeräte	3,81%
Chemische Erzeugnisse	3,77%
IT-Dienstleistungen	3,07%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	2,83%
Elektronische Ausrüstung, Geräte u. Komponenten	2,70%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	2,13%
Metalle u. Bergbau	2,10%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	1,75%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

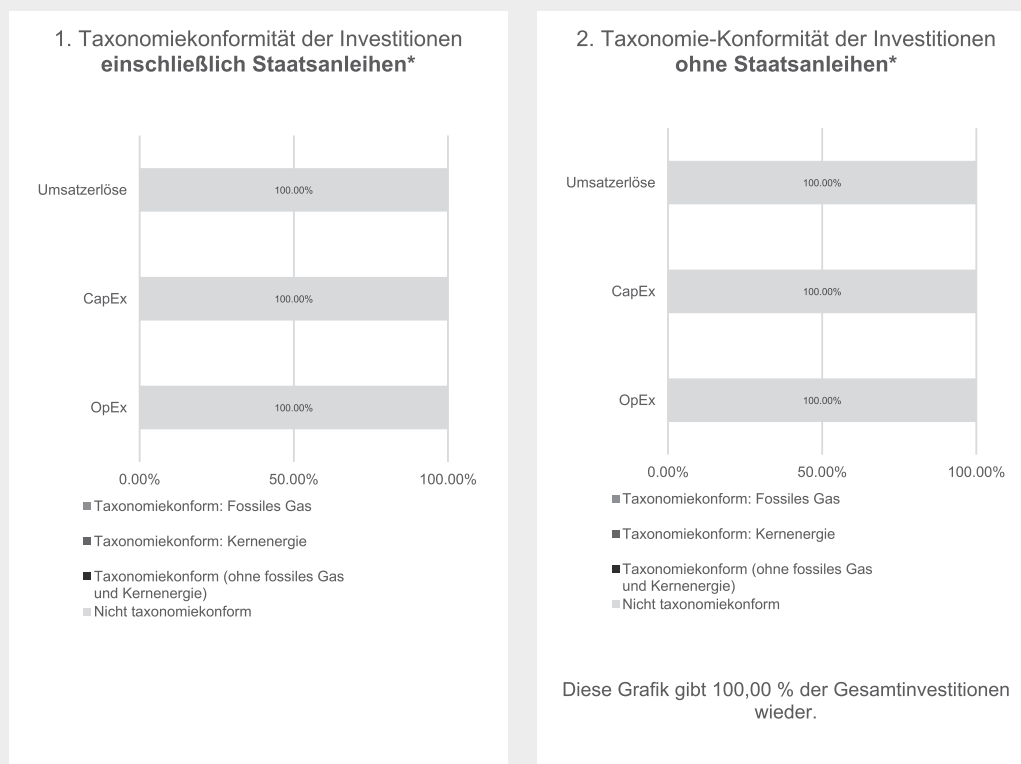
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 20,18 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 52,37 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 0,88 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

- Engagement mit Portfoliounternehmen über das Festlegen oder die Implementierung von Zielen zur Verringerung von THG-Emissionen.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf eigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Tabak, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und Kohle.
- Berücksichtigung aller 14 verbindlichen PAI und von zwei zusätzlichen PAI als Teil der Investmentanalyse, die Indikatoren zur Energie- und Wassereffizienz, Umweltverschmutzung und Risiken für die biologische Vielfalt umfassen.
- Unternehmen, die ein Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher haben, wurden nicht in den Fonds aufgenommen. Die Ratingskala reicht von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko).



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund (der „Fonds“)



Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493001JP7YZEMZJTE31

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 75,27% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Um die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen, investierte der Fonds in Unternehmen mit den folgenden Merkmalen:

- die ihren CO₂-Ausstoß reduzieren und kontrollieren,
- mit begrenztem oder gar keinem Engagement in der fossilen Brennstoffindustrie,
- mit einem Schwerpunkt auf der effizienten Nutzung von Energie und Wasser,
- die die Verschmutzung begrenzen und die Risiken für die Artenvielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und
- ohne Engagement in kontroversen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Wie im eigenen Rahmen des Anlageverwalters auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDG) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 77 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Berichtszeitraums waren etwa 62 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftlich fundierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 19 % in Unternehmen, die sich dazu verpflichtet haben, sich innerhalb der kommenden zwei Jahre entsprechende Ziele zu setzen.

Im Laufe des Berichtszeitraums intervenierte das Fondsmanagement-Team viermal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung des Vorstands und

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Klimawandelbezogene Risiken abgedeckt. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Insgesamt fanden im Berichtszeitraum 22 Interventionen statt.

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO2-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO2-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

Im Rahmen unserer Richtlinie für Klima-Engagement und Eskalation haben wir Unternehmen anhand unserer internen Kategorisierung für die Ausrichtung an Netto-Null-Zielen in verschiedene Gruppen eingestuft. Dadurch können sich unsere Kunden noch umfassender informieren. Darüber hinaus haben sie Zugang zu Informationen über Vermögenswerte, die an spezifische Ziele gebunden sind, welche auf der Grundlage der Annahme wissenschaftlich fundierter Ziele festgelegt wurden. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Engagements: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	0,00%
Engagements: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	0,00%
Engagements: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	100,00%
Engagements: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	0,00%
Engagements: 5. Unternehmen greift das Thema auf	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	62,30%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	19,60%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	8,30%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	9,80%

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Der Anteil des in Unternehmen mit wissenschaftlich fundierten Zielen investierten Nettoinventarwerts des Fonds ist im Vergleich zum vorangegangenen Berichtszeitraum von 64 % am Ende des letzten Berichtszeitraums auf 62 % leicht gesunken, während der Anteil der Unternehmen, die sich zur Festlegung wissenschaftlich fundierter Ziele verpflichtet haben, von 9 % auf 19 % gestiegen ist. Das ist auf Veränderungen in den Portfoliobeständen und darauf zurückzuführen, dass sich die Unternehmen zur Festlegung wissenschaftlich fundierter Ziele verpflichtet haben.

Im Vergleich zum Vorquartal wurde der Austausch zu ESG-Themen mit dem Ziel der Einflussnahme auf das Verhalten der Unternehmen intensiviert. Die Zahl der Interventionen stieg von 0 auf 4. Insgesamt fanden etwas weniger Interventionen statt. Die Zahl ist von 26 auf 22 zurückgegangen.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
Engagements: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	Wert	Wert
Engagements: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	0,00%	N/A
Engagements: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	0,00%	N/A
Engagements: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	100,00%	N/A
Engagements: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	0,00%	N/A
Engagements: 5. Unternehmen greift das Thema auf	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	62,30%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	19,60%	N/A
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	8,30%	N/A

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
	Wert	Wert
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	9,80%	N/A

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	14 201,20	99,16%	12 594,31	96,22%
CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	76,46	99,16%	71,95	96,22%
THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	386,71	98,50%	416,67	96,22%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,88%	0,00%	96,22%
Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs : Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,32	87,07%	0,31	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs : Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs : Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs : Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,02	87,07%	0,02	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,88%	0,00%	96,22%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%	0,01	5,04%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,05	45,55%	0,09	47,76%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,16%	0,00%	98,99%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	39,84%	97,88%	50,36%	95,15%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	19,20%	28,93%	19,03%	11,63%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	38,14%	97,88%	35,94%	96,22%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,88%	0,00%	96,22%

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten Aktien von Unternehmen, die durch ihre Produkte oder Dienstleistungen zu den ökologischen oder sozialen Zielen einer relevanten Untergruppe der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDG) beitragen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

- Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:
- 1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
- 2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO2-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.
- Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze),

- fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	14 201,20	99,16%
CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	76,46	99,16%
THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	386,71	98,50%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,88%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,32	87,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,02	87,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	87,07%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,88%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,05	45,55%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,16%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	39,84%	97,88%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	19,20%	28,93%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	38,14%	97,88%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,88%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Ferrari N.V.	Zyklische Konsumgüter	9,77%	Italien
ASML Holding N.V.	Informationstechnologie	9,59%	Niederlande
MONCLER S.P.A.	Zyklische Konsumgüter	6,71%	Italien
L'OREAL SA	Basiskonsumgüter	5,37%	Frankreich
LINDE PUBLIC LIMITED COMPANY	Grundstoffe	5,28%	Vereinigtes Königreich
Atlas Copco Aktiebolag	Industrie	4,85%	Schweden
KINGSPAN GROUP PUBLIC LIMITED COMPANY	Industrie	4,63%	Irland
ASSA ABLOY AB	Industrie	4,51%	Schweden
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC.	Gesundheitssektor	4,49%	USA
DASSAULT SYSTEMES SE	Informationstechnologie	4,34%	Frankreich
SARTORIUS STEDIM BIOTECH S.A.	Gesundheitssektor	4,28%	Frankreich
NEMETSCHEK SE	Informationstechnologie	4,23%	Deutschland
Partners Group Holding AG	Finanzsektor	4,01%	Schweiz
Hexagon Aktiebolag	Informationstechnologie	3,93%	Schweden
COLOPLAST A/S	Gesundheitssektor	3,80%	Dänemark



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

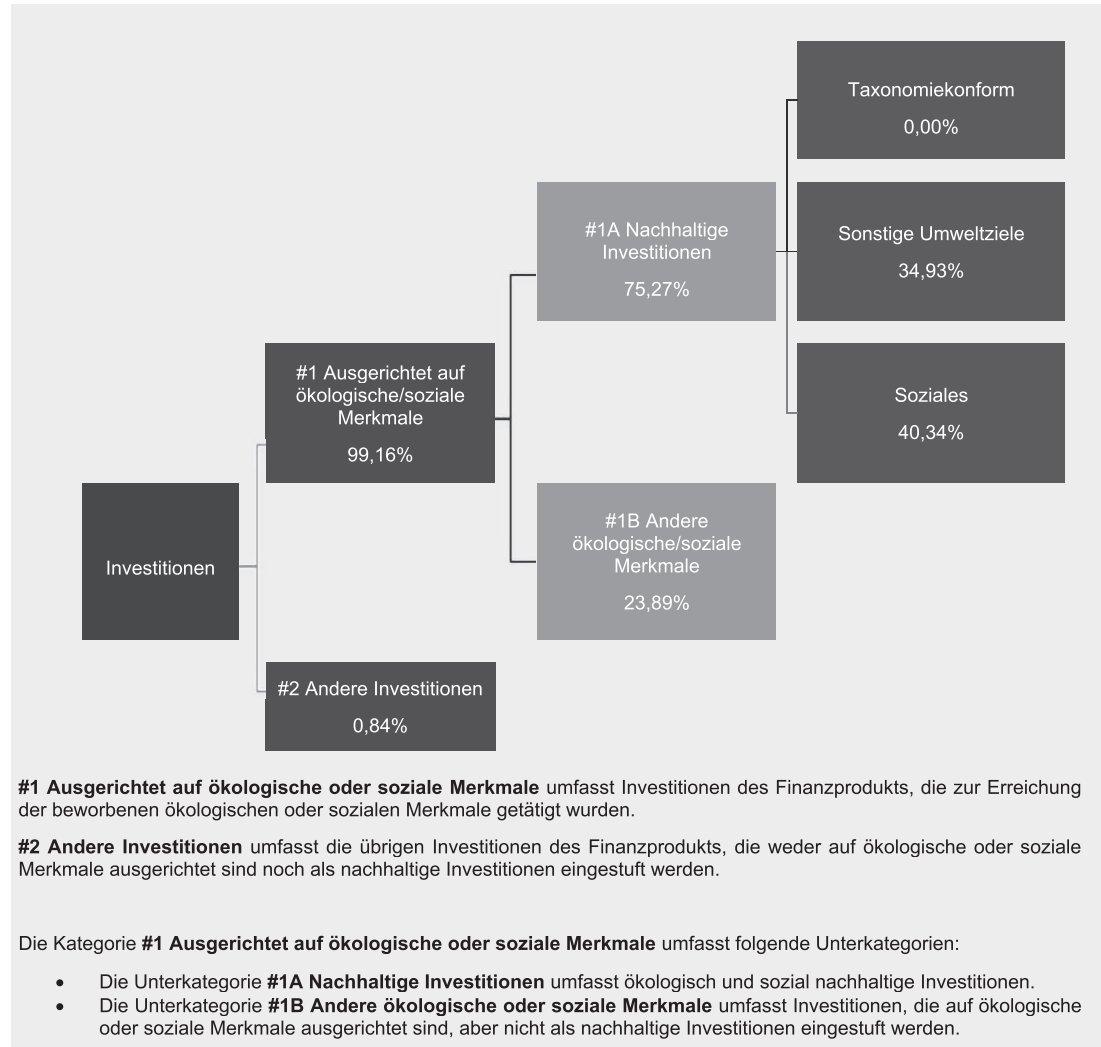
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 75,27 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,16 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,84 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 75,27 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	26,89%
Zyklische Konsumgüter	19,99%
Gesundheitssektor	14,55%
Industrie	13,88%
Basiskonsumgüter	8,66%
Grundstoffe	8,20%
Finanzsektor	6,97%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	14,49%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	10,78%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	10,30%
Automobilindustrie	9,69%
Baustoffe	9,07%
Software	8,50%
Chemische Erzeugnisse	8,20%
Produkte für den persönlichen Bedarf	5,33%
Maschinen	4,81%
Kapitalmärkte	3,97%
Elektronische Ausrüstung, Geräte u. Komponenten	3,90%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	3,77%
Finanzdienstleistungen	3,00%
Getränke	2,66%
Lebensmittel	0,68%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

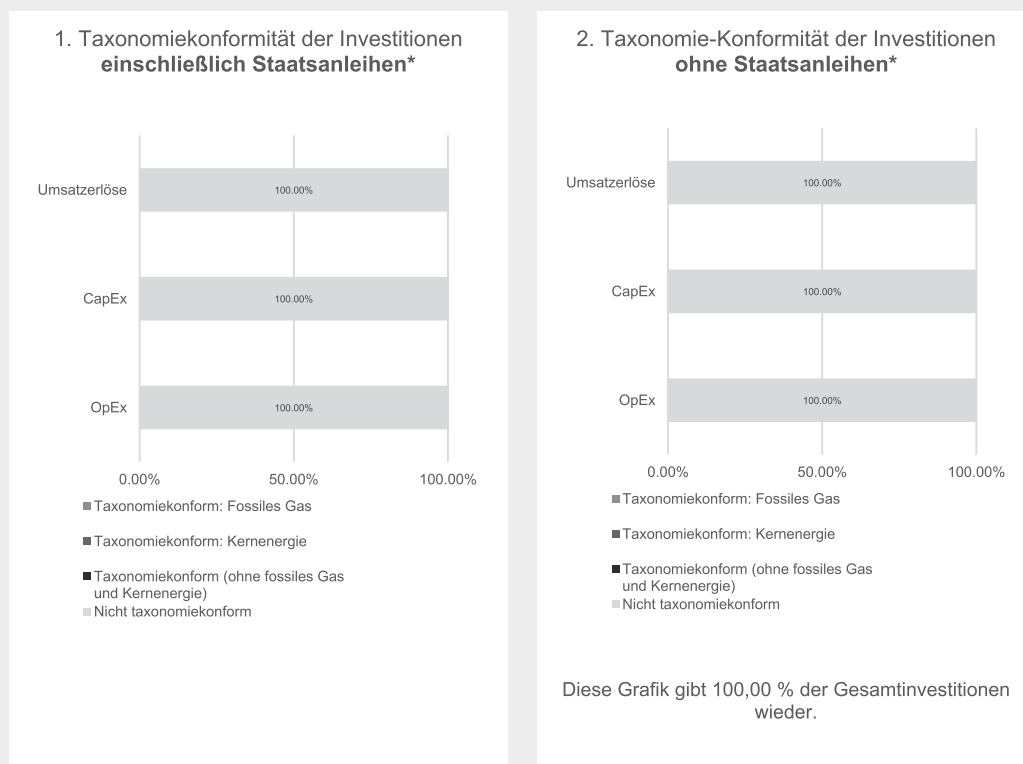
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 34,93 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 40,34 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 0,84 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

- Engagement mit Portfoliounternehmen über das Festlegen oder die Implementierung von Zielen zur Verringerung von THG-Emissionen.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf eigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und alle anderen ausgeschlossene Geschäftsaktivitäten.
- Berücksichtigung aller 14 verbindlichen PAI und von zwei zusätzlichen PAI als Teil der Investmentanalyse, die Indikatoren zur Energie- und Wassereffizienz, Umweltverschmutzung und Risiken für die biologische Vielfalt umfassen.
- Unternehmen, die ein Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher haben, wurden nicht in den Fonds aufgenommen. Die Ratingskala reicht von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko).
- Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds. Dabei handelt es sich um Aktien aus Industrie- und/oder Schwellenländern, die im MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index vertreten sind.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Martin Currie Improving Society Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900MZ0K8Z3QFWHN23



FRANKLIN
TEMPLETON

Nachhaltiges Investitionsziel

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input checked="" type="checkbox"/> JA	●○ <input type="checkbox"/> NEIN
<p><input checked="" type="checkbox"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 14,80%</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 82,10%</p>	<p><input type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p>



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Zur Erreichung des Ziels nachhaltiger Investitionen des Fonds stellen die Unternehmen, in die investiert wird, Produkte und/oder Dienstleistungen bereit, die (i) zur gesellschaftlichen Chancengleichheit beitragen, (ii) zur Verbesserung des Wohlbefindens und der Inklusion beitragen und/oder (iii) einen gerechten Übergang zu einer nachhaltigen Wirtschaft erleichtern.

Derivate wurden zur Erreichung des ökologischen/sozialen Ziels des Fonds nicht eingesetzt.

Am 29. Februar 2024 waren 98,2 % des verwalteten Fondsvermögens in Unternehmen investiert, die einen Beitrag zum Ziel der nachhaltigen Investition leisten. Die restlichen 1,8 % wurden in liquiden Mitteln gehalten.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung des Ziels der nachhaltigen Investition des Fonds festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Folgende Nachhaltigkeitsindikatoren wurden verwendet, um die Erreichung des Ziels der nachhaltigen Investition durch den Fonds zu messen:

- Der Anteil des Fonds, der auf nachhaltige Investitionen mit sozialer Zielsetzung entfällt: Im Berichtszeitraum lag der Anteil des Fonds, der in nachhaltige Anlagen mit sozialer Zielsetzung investiert wurde, bei über 70 %.
- Der Anteil des Fonds, der auf ökologisch nachhaltige Investitionen entfällt, welche die soziale Zielsetzung des Fonds unterstützen: Im Berichtszeitraum wurde der Anteil des Fonds, der nicht in nachhaltige Anlagen mit sozialer Zielsetzung investiert oder in liquiden Mitteln gehalten wurde, in nachhaltige Anlagen mit ökologischer Zielsetzung investiert, welche die soziale Zielsetzung des Fonds unterstützen.
- Der Anteil des Fonds, der die für jedes Unternehmen festgelegten Leistungskennzahlen (Key Performance Indicators – KPIs) erfüllt, übertrifft oder unterschreitet. Am Ende des Berichtszeitraums stellte sich der Stand der KPIs für das gesamte Portfolio wie folgt dar:
- Der Anteil des Fonds, der über einen strukturierten Mitwirkungsprozess verfügt:
 - Schwerpunkt auf den Bereichen, in denen sich der Anlageverwalter für bestimmte KPIs des Unternehmens einsetzt; und

- Schwerpunkt auf der Verbesserung des Verhaltens im Bereich der Nachhaltigkeit.

Während des Berichtszeitraums fanden bei 100 % des Fonds Interventionen in mindestens einem der oben genannten Bereiche statt.

Im Rahmen unserer Richtlinie für Klima-Engagement und Eskalation haben wir Unternehmen anhand unserer internen Kategorisierung für die Ausrichtung an Netto-Null-Zielen in verschiedene Gruppen eingestuft. Dadurch können sich unsere Kunden noch umfassender informieren. Darüber hinaus haben sie Zugang zu Informationen über Vermögenswerte, die an spezifische Ziele gebunden sind, welche auf der Grundlage der Annahme wissenschaftlich fundierter Ziele festgelegt wurden. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Wirkungsbezogene KPIs: Erfüllung	70,45%
Wirkungsbezogene KPIs: Überschreitung	17,05%
Wirkungsbezogene KPIs: Unterschreitung	12,50%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	32,90%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	24,90%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	5,20%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	35,20%

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO₂-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflusst haben. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

--- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
INTUITIVE SURGICAL, INC.	Gesundheitssektor	6,78%	USA
XYLEM INC.	Industrie	6,34%	USA
HDFC BANK LIMITED	Finanzsektor	5,49%	Indien
NOVOZYMES A/S	Grundstoffe	5,42%	Dänemark
MERCADOLIBRE, INC.	Zyklische Konsumgüter	5,37%	Uruguay
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	Versorgungsunternehmen	4,97%	Frankreich
ECOLAB INC.	Grundstoffe	4,94%	USA
REVVITY, INC.	Gesundheitssektor	4,94%	USA
CRODA INTERNATIONAL PUBLIC LIMITED COMPANY	Grundstoffe	4,68%	Vereinigtes Königreich
VALMONT INDUSTRIES, INC.	Industrie	4,51%	USA
AMPLIFON S.P.A.	Gesundheitssektor	4,29%	Italien
VEEVA SYSTEMS INC.	Gesundheitssektor	4,26%	USA
DEERE & COMPANY	Industrie	4,18%	USA
AIRTEL AFRICA PLC	Kommunikationsdienste	4,04%	Vereinigtes Königreich
ILLUMINA, INC.	Gesundheitssektor	3,63%	USA



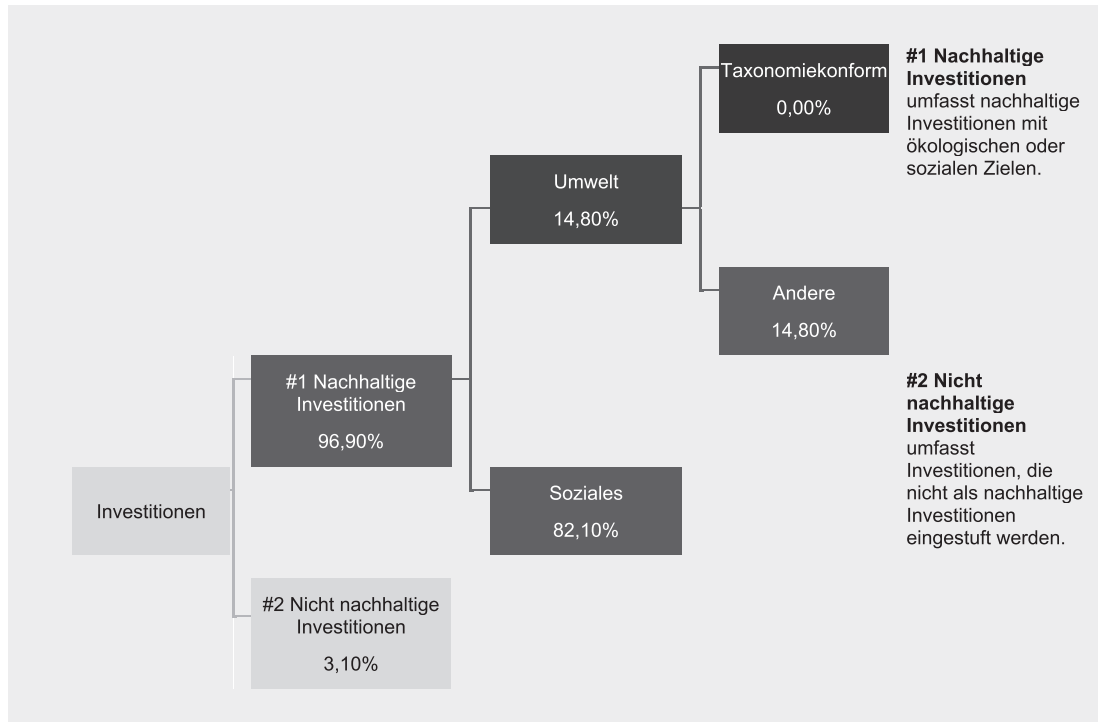
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 96,90 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

96,90 % des NIW des Fonds wurden in nachhaltige Anlagen investiert. Der verbleibende Teil (3,10 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Gesundheitssektor	27,04%
Industrie	19,17%
Grundstoffe	15,04%
Zyklische Konsumgüter	14,81%
Finanzsektor	8,57%
Versorgungsunternehmen	6,15%
Kommunikationsdienste	4,04%
Informationstechnologie	2,05%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Chemische Erzeugnisse	15,04%
Maschinen	12,09%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	9,92%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	8,57%
Banken	8,57%
Allgemeiner Einzelhandel	5,37%
Multi-Versorger	4,97%
Bau- u. Ingenieurwesen	4,51%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	4,29%
Gesundheitstechnologie	4,26%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	4,04%
Diversifizierte Verbraucherdienstleistungen	3,69%
Langlebige Haushaltsgüter	2,79%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	1,63%
Fachdienstleistungen	1,51%



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

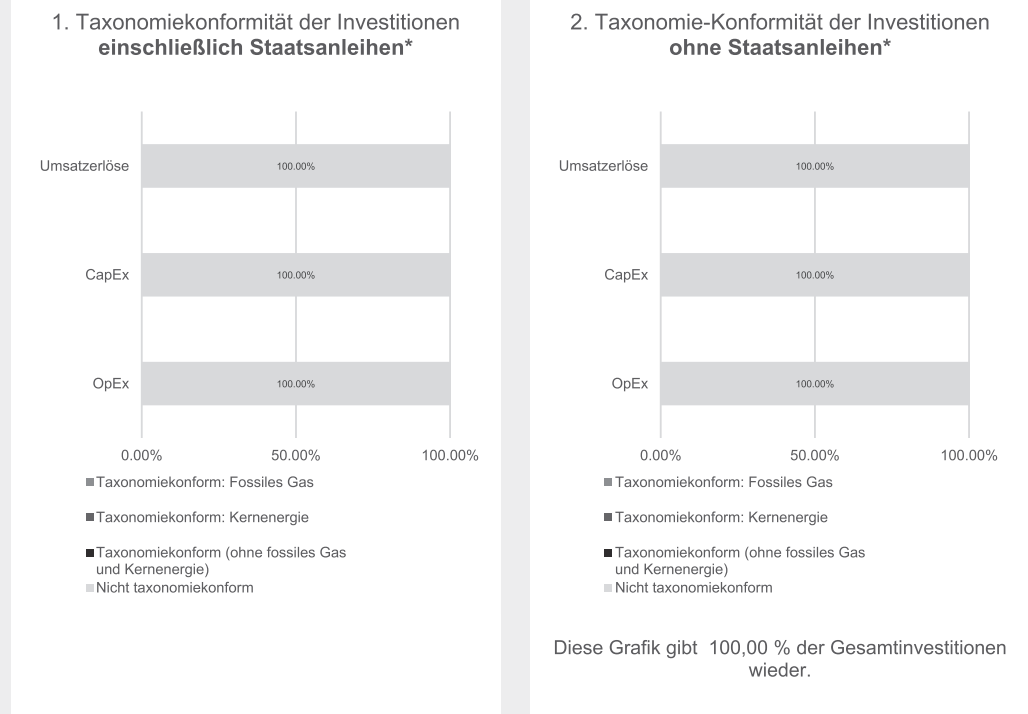
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen während des Referenzzeitraums Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 14,80 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug während des Referenzzeitraums 82,10 %.



Welche Investitionen fielen unter „Nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 3,10 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Die Portfoliomanager sprachen mit den Portfoliounternehmen über die von ihnen durch ihre Produkte und Dienstleistungen erzielten Auswirkungen oder über die Verbesserung ihres Verhaltens im Bereich der Nachhaltigkeit.

Alle im Verkaufsprospekt genannten Ausschlusskriterien wurden eingehalten. Nähere Angaben dazu finden Sie im Anhang zum Fonds.

Bei der Investmentanalyse wurden alle der 14 verbindlichen PAI und zwei zusätzliche PAI berücksichtigt.

Das MSCI-ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds (MSCI ACWI IMI).



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt das nachhaltige Ziel erreicht.

Franklin Responsible Income 2028 Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900FTK4TK4QA6CU84



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 15,72% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Zur Förderung des Übergangs zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft hat das Team des Portfoliomanagements Engagements in so genannten „Klima-Nachzüglern“ gemieden. Als „Klima-Nachzügler“ wurden staatliche Emittenten bezeichnet, die bei Umweltfaktoren wie unter anderem Treibhausgasemissionen, Energieintensität, Schutz der Artenvielfalt, Luftverschmutzung und Mix erneuerbarer Energien zu den schlechtesten 20 % ihrer Vergleichsgruppe gehörten. Dabei handelte es sich bei Unternehmensemittenten um Unternehmen, die basierend auf der Treibhausgasintensität zu den oberen 20 % ihrer Branchenvergleichsgruppe zählten. Am Ende des Berichtszeitraums lag die Allokation des Teilfonds in Klima-Nachzüglern bei 0 % seines Nettoinventarwerts (NIW) während des Referenzzeitraums.

Zudem hat der Teilfonds nicht in Emittenten investiert, die in umstrittene Geschäftspraktiken oder nachteilige Wirtschaftstätigkeiten verwickelt sind (wie in den vorvertraglichen Informationen näher beschrieben). Dies gilt unter anderem für Emittenten, deren Beteiligung an der Förderung fossiler Brennstoffe oder an der Energieerzeugung aus fossilen Brennstoffen über das vom Anlageteam für akzeptabel erachtete Niveau hinausging (z. B. wird jedes Unternehmen, das mehr als 5 % seines Umsatzes aus der Förderung von Kraftwerkskohle erzielt, für nicht investierbar erachtet). Weitere Beispiele sind Emittenten, die in die Herstellung von Massenvernichtungswaffen verwickelt sind oder Unternehmen, die erheblich und wiederholt gegen den United Nations Global Compact verstoßen. Abgesehen von den aufgeführten Ausschlüssen hat der Teilfonds auch nicht in staatliche Emittenten investiert, die nach dem Freedom House Index als „nicht frei“ eingestuft werden.

Der Teilfonds hat sich zu einer Mindestallokation von 11 % seines NIW in nachhaltigen Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten verpflichtet, die zu ökologischen Zielen beitragen, und zu einer Mindestallokation von 1 % in solche, die zu sozialen Zielen beitragen. Im Berichtszeitraum waren 15,72 % des NIW des Teilfonds in nachhaltigen Investitionen angelegt (siehe detaillierte Aufgliederung im unten stehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“; sofern nicht anders angegeben, basieren alle angegebenen Werte auf dem gewichteten Durchschnitt von vier Quartalen während des Berichtsreferenzzeitraums). Erreicht wurde dies hauptsächlich durch Investitionen in Anleihen, bei denen die Mittel für grüne, soziale und nachhaltige Zwecke verwendet werden und die ausdrücklich für die Finanzierung geeigneter ökologischer und/oder sozialer Projekte begeben werden. Ein Beispiel dafür ist die Investition des Teilfonds in eine von der ABN AMRO Bank N.V. begebene Anleihe, mit der das Ziel verfolgt wird, den Anteil der erneuerbaren Energien am globalen Energiemix bis 2030 deutlich zu erhöhen und die Widerstandsfähigkeit gegenüber dem Klimawandel und Naturkatastrophen zu verbessern. Der größte Teil der mit der Anleihe beschafften Mittel wurde in die Förderung der Energieeffizienz gelenkt. Energieeffizienz ist beispielsweise mit Krediten für Solaranlagen auf bestehenden Häusern, nachhaltige Gewerbeimmobilien und Windenergie verbunden. Zu nennen sind hier unter anderem die verstärkte Finanzierung von Immobilien mit dem Energieausweis A oder besser. Die ABN AMRO Bank hat außerdem ihre Investitionen in Projekte im Bereich der erneuerbaren Energien ausgeweitet, etwa durch die Finanzierung des Neubaus eines mit Methanol betriebenen MR-Tankers.

Diesbezüglich machte der gewichtete Durchschnitt über vier Quartale während des Berichtszeitraums vom 1. März 2023 bis zum 29. Februar 2024 98,56 % der Vermögenswerte aus, die auf die ökologischen und/ oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren,

während die restlichen 1,44 % der vom Teilfonds gehaltenen Vermögenswerte, die nicht auf die ökologischen/sozialen Merkmale ausgerichtet waren, aus liquiden Mitteln bestanden.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren wurden angewendet, um die Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewirbt:

Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen Anleihen (GSS-Anleihen) und solchen, die von Umweltchampions begeben wurden.

- 11,24 % Anlagen in grünen Anleihen;
- 4,48 % Anlagen in sozialen Anleihen;
- 0,00 % Anlagen in Nachhaltigkeitsanleihen;
- 41,10 % Anlagen in Anleihen, die von Best-in-Class Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden.

Prozentualer Anteil der Investitionen in Emittenten, die in ausgeschlossenen Sektoren tätig sind oder mit diesen in Verbindung stehen, sowie zusätzliche Ausschlüsse, wie im Abschnitt über die Anlagestrategie in diesem Anhang näher beschrieben – 0,00 %

Der Anlageverwalter stand zwischen dem 1. März 2023 und dem 29. Februar 2024 mit folgenden Emittenten im Austausch:

1. ABANCA Corporacion Bancaria 2. Abertis 3. ABN AMRO Bank 4. Adevinta 5. AIB Group 6. Altice France 7. Apple 8. Arena Luxembourg Finance 9. Atlantia 10. Autostrade per l'Italia 11. Avantor 12. Azelis 13. Banco Sabadell 14. Bank of Ireland 15. Barclays 16. Berry Global 17. Blackstone Property Partners Europe Holdings 18. BNP Paribas 19. Caixa Geral de Depositos 20. CaixaBank 21. CEZ Group 22. Commerzbank AG 23. Credit Agricole Assurances 24. Credit Suisse 25. Crown European Holdings 26. Danske Bank 27. DXC Technology 28. EasyJet 29. Eaton Vance 30. ENGIE 31. Goldman Sachs 32. Holding d'Infrastructures 33. HSBC 34. Ibercaja Banco 35. IBM 36. iliad Group 37. IMA Group 38. ING Groep NV 39. Intesa Sanpaolo 40. IQVIA 41. Italmatch Chemicals 42. JPMorgan Chase 43. LKQ Corp 44. Logicor 45. Lufthansa Group 46. Matterhorn Telecom 47. National Grid 48. Nationwide Building Society 49. NatWest 50. Orano 51. Paprec 52. Prosus 53. PVH Corp. 54. Rabobank 55. Renault Group 56. Romania 57. Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 58. SANEF 59. Santander Group 60. Santander UK 61. Schneider Electric 62. Societe Generale 63. Swedbank 64. TenneT 65. Thames Water 66. UBS Group AG 67. Unicaja Banco 68. Verisure 69. Verizon 70. Victoria PLC 71. Volvo Cars 72. Vonovia SE

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Engagement in grünen Anleihen	11,24%
Engagement in sozialen Anleihen	4,48%
Engagement in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%
Engagement in Umweltchampions	41,10%
Engagement in ausgeschlossenen Sektoren	0,00%
Engagement im Hinblick auf Indikatoren wesentlicher negativer Auswirkungen (Principle Adverse Impact – PAI-Indikatoren)	1,00
Die Liste der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter zusammenarbeitet	1,00

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Ein direkter Vergleich kann nicht angestellt werden, da der Fonds am 23. Januar 2023 aufgelegt wurde. Der erste Berichtszeitraum umfasste daher etwas mehr als einen Monat zwischen dem 23. Januar 2023 und dem 28. Februar 2023, während im vorliegenden Bericht der Berichtszeitraum ein volles Geschäftsjahr vom 1. März 2023 bis zum 29. Februar 2024 umfasst.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Zu den Zielsetzungen nachhaltiger Anlagen gehörten unter anderem die Finanzierung und Förderung von:

- a) der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- b) der Erzeugung erneuerbarer Energie,
- c) der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- d) der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- e) der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- f) der sozialen Integration,
- g) guter Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- h) Investitionen in Humankapital, einschließlich benachteiligter Gemeinschaften.

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten eine Mindestallokation von 10 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten, die zu Umweltzielen beitragen.

Dies wurde durch Investitionen in als „grün“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,

B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang steht (u. a. den Green Bond Principles der International Capital Market Association („ICMA“) und dem künftigen Green Bond Standard der Europäischen Union („EU GBS“) und

C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigen und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Die Verwendung der Mittel für diese Anleihen war klar definiert und auf die oben genannten Ziele ausgerichtet.

Darüber hinaus verpflichtete sich der Fonds, mindestens 1 % seines Portfolios in nachhaltige soziale Aktivitäten zu investieren. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,

B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang steht (u. a. den Social Bond Principles der ICMA), und

C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigen und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen.

Unternehmensemittenten wurden mit Hilfe der Principle Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten von MSCI, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche wirtschaftliche Aktivitäten und/oder Kontroversen verwickelt waren. Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf biodiversitätssensible Gebiete auswirken), Nr. 10 (Verletzung der Prinzipien des UN Global Compact und der OECD für multinationale Unternehmen) und Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen) verstoßen, wurden vom Anlageuniversum des Fonds ausgeschlossen.

Der Anlageverwalter verwendete auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Fonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Intensität einstuft. Emittenten, die in Bezug auf PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen) und Nr. 3 (CO₂-Bilanz) (für Unternehmen) und PAI Nr. 15 (THG-Intensität) (für Staaten) zu den untersten 20 % ihrer Vergleichsgruppen gehörten, wurden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten (PAI Nr. 16) und/oder Korruption überprüft.

Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm der Anlageverwalter eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Indikatoren nachteiliger Auswirkungen, darunter PAI und andere Datenpunkte, die der Anlageverwalter als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden zu Folgendem benutzt:

a. der Entfernung von Emittenten, die dem Portfolio wesentlich schaden, und

b. um die Anlageverwaltung über das mit nachteiligen Auswirkungen verbundene Risiko zu informieren und geeignete Maßnahmen zu ergreifen – dazu gehören Due-Diligence-Prüfungen, qualitative Prüfungen und/oder aktive Beteiligung (Einzelheiten zum Thema aktive Beteiligung sind in den Abschnitten „Wesentliche nachteilige Auswirkungen“ und „Anlagestrategie des Teilfonds“ des Fonds in diesem Anhang zu finden).

Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüfte und dokumentierte die Anlageverwaltung die Wesentlichkeit der relevanten PAI für das Projekt sowie die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten.

Wenn der Anlageverwalter beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte er sich, dass die finanzierten Projekte in Bezug auf die PAI für Treibhausgasemissionen gut abschnitten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Bei Anleihen, die von souveränen Staaten begeben wurden, waren die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte nicht auf solche Investitionen anwendbar. Bei Anleihen, die von Unternehmen begeben wurden, standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang.

Diese Konformität wurde mit Hilfe von MSCI-Daten überwacht. Von diesen Dienstleistern festgestellte Verstöße wurden im Investment-Compliance-System gekennzeichnet, damit die Anlageverwaltung sie untersuchen konnte.

Ergab die Due-Diligence-Prüfung, dass der Emittent die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte nicht eingehalten hat, wurde er als nicht investierbar eingestuft.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

- (i) Identifizierung von Emittenten, die als „Best-in-Class“ gelten,
- (ii) Beschränkung des Anlageuniversums des Fonds und
- (iii) Hilfestellung für thematisches Engagement

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Fonds investierte in Anleihen von Unternehmen und Staaten, die vom Anlageverwalter als „Umweltchampions“ eingestuft wurden. „Umweltchampions“ wurden anhand von zwei proprietären ESG-Rankings identifiziert:

- Der EETI bewertet die Leistung staatlicher Emittenten in den Bereichen Energieeffizienz, Erhaltung des Naturkapitals und erneuerbare Energien anhand verschiedener Datenpunkte, einschließlich der Treibhausgasintensität (Emissionen normiert nach Bruttoinlandsprodukt, CO₂e/BIP).
- Die ESG Credit App stuft Unternehmensemittenten nach ihren THG-Emissionen und ihrer THG-Emissionsintensität ein und verwendet dazu verschiedene Datenpunkte, wie z. B. die Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen sowie die historische Entwicklung der THG-Emittenten.

Einschränkung des investierbaren Universums des Fonds

Staatliche Emittenten, die basierend auf dem EETI zu den untersten 20 % des Anlageuniversums gehören, und Unternehmensemittenten, die basierend auf der ESG Credit App zu den untersten 20 % gehören (d. h. Klima-Nachzügler), wurden ebenfalls aus dem Portfolio ausgeschlossen.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwaltung verpflichtete sich zu einem Engagement bei 5 % der aktiven Beteiligungen, die in Bezug auf ihre gesamten Risikopositionen gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

Weitere Informationen darüber, wie der Fonds seine PAI berücksichtigt hat, befinden sich in den regelmäßigen Berichten des Fonds.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO ₂ e	3 138,53	71,04%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO ₂ e	310,51	71,04%
THG-Emissionen: Scope 3 (EUR)	tCO ₂ e	14 877,17	71,04%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO ₂ e	3 449,04	71,04%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO ₂ e	18 392,30	71,04%
CO ₂ -Bilanz 1&2 (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	57,62	71,04%
Geschätzte CO ₂ -Bilanz (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	310,66	71,04%
THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	74,78	88,21%
Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	749,46	88,37%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	4,32%	84,69%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	64,38%	67,18%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	65,27%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	65,27%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,18	65,27%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	8,66	65,27%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	65,27%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,09	65,27%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,03	65,27%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,47	65,27%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	65,27%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	84,69%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,45	14,85%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	86,53%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	26,14%	84,69%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	23,02%	29,76%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	37,87%	84,69%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	84,69%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	481,28	2,02%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	2,02%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Romanian Government International Bond 2.125% 03/07/2028 REG S	Staatsanleihen	2,02%	Rumänien
Intesa Sanpaolo Spa 1.75% 03/20/2028 REG S	Finanzsektor	1,58%	Italien
Bank Of Ireland Group PLC 4.875% 07/16/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,54%	Irland
UBS Group AG 4.625% 03/17/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,53%	Schweiz
BNP Paribas SA .5% 02/19/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,53%	Frankreich
National Grid PLC .163% 01/20/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	1,51%	Vereinigtes Königreich
ABN AMRO Bank NV 4% 01/16/2028 REG S	Finanzsektor	1,51%	Niederlande
AIB Group PLC 2.25% 04/04/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,51%	Irland
ING Groep NV 4.875% 11/14/2027 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,51%	Niederlande
Skandinaviska Enskilda Banken AB .375% 06/21/2028 REG S	Finanzsektor	1,50%	Schweden
Thermo Fisher Scientific Inc .5% 03/01/2028	Gesundheitssektor	1,49%	USA
Crelan SA 5.75% 01/26/2028 REG S	Finanzsektor	1,49%	Belgien
Barclays PLC .877% 01/28/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,49%	Vereinigtes Königreich
Sage Group PLC/The 3.82% 02/15/2028 REG S	Informationstechnologie	1,48%	Vereinigtes Königreich
Natwest Markets PLC 4.25% 01/13/2028 REG S	Finanzsektor	1,48%	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

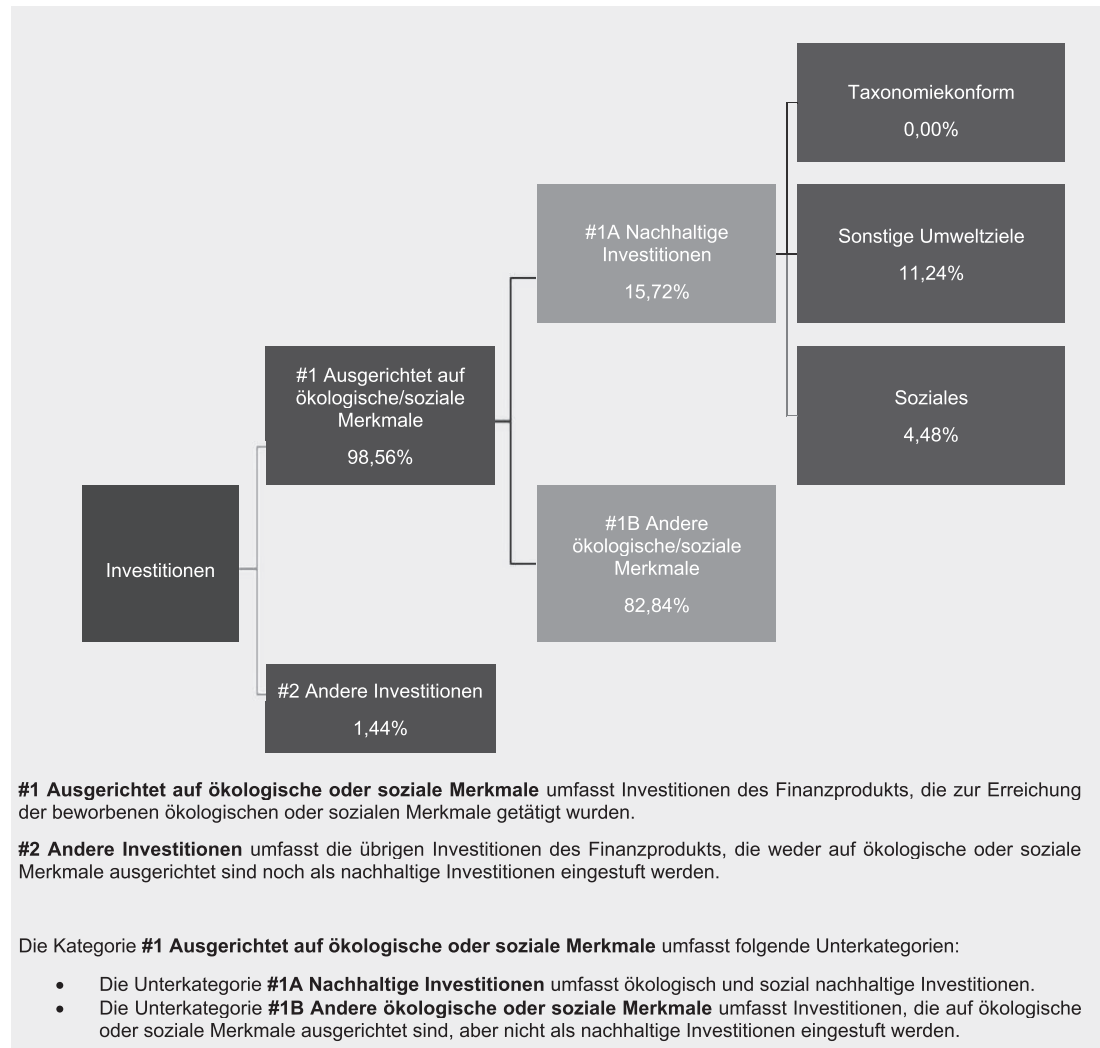
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen liegt bei 15,72 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 98,56 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet (sofern nicht anders angegeben, basieren alle angegebenen Werte auf dem gewichteten Durchschnitt von vier Quartalen während des Berichtsreferenzzeitraums). Der verbleibende Teil (1,44 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 15,72 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	49,73%
Industrie	14,83%
Zyklische Konsumgüter	6,58%
Kommunikationsdienste	6,13%
Gesundheitssektor	5,85%
Versorgungsunternehmen	5,58%
Informationstechnologie	4,45%
Grundstoffe	2,77%
Staatsanleihen	2,02%
Immobilien	0,52%
Basiskonsumgüter	0,12%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	34,44%
Finanzdienstleistungen	7,06%
Kapitalmärkte	6,92%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	3,27%
Multi-Versorger	2,95%
Elektronikgeräte	2,52%
Fachdienstleistungen	2,43%
Passagierfluggesellschaften	2,41%
Behältnisse u. Verpackungen	2,28%
Stromversorger	2,27%
Verkehrsinfrastruktur	2,18%
Software	2,07%
Staatsanleihen	2,02%
Überlandtransport	1,62%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	1,51%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ersichtlich darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

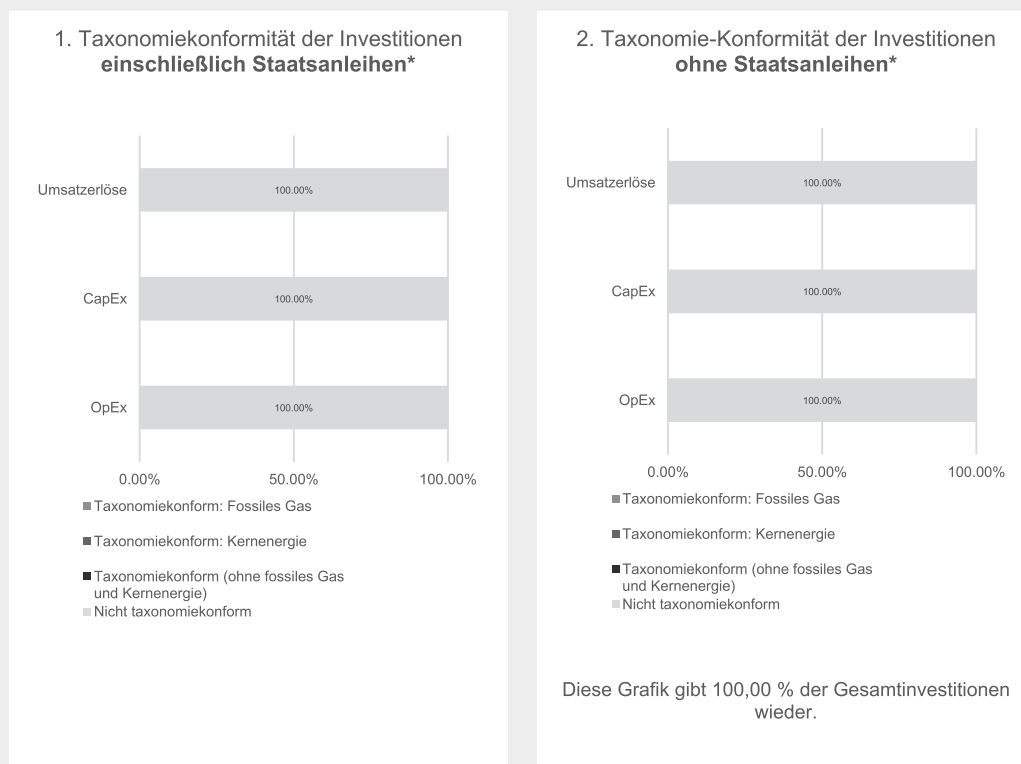
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

11,24 % des Fondsportfolios bestanden aus Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 4,48 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ lag bei 1,44 % und umfasste liquide Anlagen (zusätzliche liquide Mittel, Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds), die zur Deckung des täglichen Bedarfs des Fonds gehalten wurden.

Es gab keine ökologischen und/oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Der Anlageverwalter setzte zahlreiche IT-Tools ein, um das Portfolio so zusammenzustellen, dass es auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist. Diese Merkmale umfassten die Förderung des Übergangs zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft durch Vermeidung von Investitionen in Emittenten, die beim Übergang zurückliegen, und die Einrichtung negativer Screenings als Teil des Anlageprozesses. Mithilfe interner und externer Inputdaten (z. B. von MSCI) beurteilten die Anlageverwalter, welche Emittenten für das Portfolio in Frage kamen und welche nicht.

Der Fonds wendete beispielsweise eine eigene ESG-Ratingmethodik an, um Anlagen in Emittenten zu vermeiden, die bei der Umstellung auf eine kohlenstoffarme Wirtschaft zurückliegen. Der Fonds wendete einen selektiven Ansatz an, um Emittenten (Unternehmen und Staaten) aus seinem Portfolio auszuschließen, die in Bezug auf verschiedene Merkmale zu den unteren 20 % seines Anlageuniversums gehörten. Bei Unternehmen prüfen die Anlageverwalter deren Treibhausgasemissionen und -intensität, während sie bei Staaten eine Liste von 16 ökologischen Indikatoren wie Energieeffizienz, Schutz der Artenvielfalt und verantwortungsvolle Abfallwirtschaft zugrunde legen. Ein innovatives IT-Tool (Energy and Environmental Transition Index [EETI]) für Staaten und die ESG Credit App für Unternehmen weist den Emittenten auf der Grundlage dieser Merkmale einen Rang zu und verkleinert das investierbare Universum um die vorgenannten 20 %.

Der Fonds führt eine eigene Ausschlussliste, und dementsprechend haben die Anlageverwalter nicht in Emittenten investiert, die:

- wiederholt und schwerwiegend gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen, die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen verstoßen,
- den Status „Unfrei“ nach dem Freedom House Index (bei staatlichen Emittenten) aufweisen,
- umstrittene Waffen herstellen, z. B. solche, die als Streuwaffen bzw. unterschiedslos wirkend definiert sind, oder in Unternehmen, die Komponenten herstellen, welche für den Einsatz in derartigen Waffen vorgesehen sind,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Produktion konventioneller Waffen erzielen
- Tabak oder Tabakwaren herstellen oder die Umsätze aus solchen Waren erzielen, die die Obergrenzen der Anlageverwalter überschreiten (5 %),
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus Glücksspiel oder Erotik erzielen,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und deren Verkauf an Dritte erzielen,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse mit äußerst umweltschädlichen fossilen Brennstoffen erzielen,
- die Toleranzgrenzen der Anlageverwalter für fossile Brennstoffe (30 %) oder Kraftwerkskohle (5 %) zur Stromerzeugung überschreiten oder keine ehrgeizigen Dekarbonisierungsziele für die Stromerzeugung verfolgen,
- sich negativ auf die biologische Vielfalt empfindlicher Gebiete auswirken und
- ein ESG-Rating von CCC nach MSCI aufweisen.

Darüber hinaus wurden die Emittenten mithilfe der Principle Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die App analysiert die Entwicklung von Unternehmen und staatlichen Emittenten auf der Grundlage der 14 verpflichtenden PAI-Kennzahlen (Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen). Die PAI-App hat im Vorfeld Emittenten identifiziert und aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen, die:

- wiederholt und gravierend gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen verstoßen (PAI Nr. 10),
- eine Verbindung zu umstrittenen Waffen haben (PAI Nr. 14),
- in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität tätig und in Kontroversen mit schwerwiegenden Auswirkungen auf die Umwelt verwickelt sind (PAI Nr. 7)
- Länder sind, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

2. Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm der Anlageverwalter eine zusätzliche

qualitative Bewertung (d. h. das Bewertungsformular zu nachhaltigen Anlagen auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

Aufgrund des Anspruchs der Anlageverwalter, eine positive Auswirkung auf ökologische und soziale Aspekte zu erzielen und die aufsichtsrechtlichen Anforderungen zu erfüllen, prüfen die Anlageverwalter zunächst, ob alle förderfähigen Vorhaben für eine Anleihe, die für den Kauf in Frage kommt, tatsächlich nachhaltig sind und einen positiven Beitrag zu ökologischen und/oder sozialen Zielen leisten. Danach stellen die Anlageverwalter sicher, dass weder der Emittent noch die über die Anleihe finanzierten Projekte anderen ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Gleichzeitig prüfen die Anlageverwalter die Gesamtauswirkungen eines Emittenten auf die Umwelt. So würden sie beispielsweise nicht in ein Versorgungsunternehmen investieren, das trotz Investitionen in grüne Energie seine mit fossilen Brennstoffen betriebene Stromerzeugungskapazität erhöht. Genauso wichtig sind soziale Aspekte, und die Anlageverwalter investieren nicht in grüne oder soziale Projekte, wenn nachweislich schwerwiegende Kontroversen im Zusammenhang mit den Mitarbeitern und/oder der örtlichen Kommune bestehen. Bei der Beurteilung dieser Parameter achten die Anlageverwalter auf 16 verpflichtende Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI).

3. Engagement war integraler Bestandteil des Nachhaltigkeitsansatzes und ESG-Managements des Fonds. Während des Referenzzeitraums führten die Anlageverwalter Gespräche mit zahlreichen Emittenten. Dies geschah per E-Mail, durch direkte Videoanrufe, durch die Teilnahme an Roadshows oder persönlichen Treffen sowie durch eine breit angelegte Beteiligung, indem Umfragen zu einem bestimmten Thema verschickt wurden. Dabei ging es sowohl um ein freiwilliges Engagement, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds zu fördern und Daten für eine fundierte Anlageentscheidung zu erhalten, als auch um ein verpflichtendes Engagement bei 5 % der Emittenten, die in Bezug auf die PAI-Risiken schlechter abschnitten als ihre Mitbewerber.

Alle Engagements sind oben im Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“ aufgeführt. Das nachfolgende Beispiel soll jedoch den Ansatz der Portfoliomanager verdeutlichen. Im Berichtszeitraum haben sich die Anlageverwalter auf freiwilliger Basis mit dem Telekommunikationsunternehmen Verizon in Verbindung gesetzt, wobei es insbesondere um die Themen Energieemissionen und digitale Ausgrenzung ging. Die Verantwortlichen von Verizon teilten uns mit, dass sie an der Optimierung des Netzes arbeiten, und zwar anhand von Netto-Null-Zielen, die von der SBTi für den Betrieb unter Berücksichtigung der Emissionen der Wertschöpfungskette validiert wurden. Scope-2-Emissionen werden durch virtuelle Ökostrom-Kraftwerke gesenkt, die über einen Stromabnahmevertrag mit einem unabhängigen Ökostromerzeuger ausgelagert werden. Der Konzern hat Kupfer durch Glasfaserkabel ersetzt, die bei gleicher Bandbreite energieeffizienter sind. Das Unternehmen nutzt zudem KI und maschinelles Lernen, um das Netz besser zu optimieren. In Bezug auf die digitale Integration ist 4G nach Angaben des Unternehmens das zentrale Element, das alle US-Bürger erreichen und dafür sorgen wird, dass weder städtische noch ländliche Gemeinden ausgegrenzt werden. Bei der digitalen Ausgrenzung geht es um drei Themen: Zugang, Anpassung und Erschwinglichkeit. Zunächst müssen unterversorgte Gebiete Zugang erhalten. Anpassung bedeutet, dass Menschen ohne digitale Kenntnisse in die Lage versetzt werden müssen, am Anschluss teilzuhaben. Und nicht zuletzt geht es um die Erschwinglichkeit, die durch den Abbau wirtschaftlicher Barrieren erreicht werden soll.

Die Anlageverwalter interagieren weiterhin mit den Emittenten, bei denen sie Beteiligungen besitzen. Darüber hinaus arbeiteten die Anlageverwalter im Rahmen eines Engagements mit 5 % der Beteiligungen zusammen, die in Bezug auf ihre Gesamtexponierung gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten. Ein anschauliches Beispiel für dieses obligatorische Engagement ist die Kommunikation des Anlageverwalters mit dem Chemieunternehmen Italmatch Chemicals, bei der es sich um die Festlegung eines SBTi-Ziels (Science Based Target Initiative) drehte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

